

# 国都聚益定期开放混合型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：国都证券股份有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 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.....	42
7.7 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.....	43
7.8 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.....	43
7.9 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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	46
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>47</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>50</b>

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国都聚益定期开放混合型证券投资基金
基金简称	国都聚益定期开放
场内简称	-
基金主代码	004245
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 5 月 3 日
基金管理人	国都证券股份有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	28, 223, 264. 64 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争超越业绩比较基准，实现基金资产的保值和增值
投资策略	本基金跟踪和分析宏观经济变量和各项国家政策，通过定性与定量分析，判断经济形势及未来发展趋势，同时结合资本市场所处环境以及各类资产的预期收益与风险，合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争实现投资组合的稳定增值
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中国债券总指数收益率×60%+沪深 300 指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益风险水平的投资品种

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国都证券股份有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李昭	吴荣

	联系电话	010-84183229	021-62699999
	电子邮箱	lizhao@guodu.com	011693@cib.com.cn
客户服务电话		400-818-8118	95561
传真		010-84183311	021-62535823
注册地址		北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9、10 层	福建省福州市湖东路 154 号
办公地址		北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9、10 层	上海市静安区江宁路 168 号 20 楼
邮政编码		100007	200041
法定代表人		王少华（待变更）	高建平

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.guodu.com
基金半年度报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-658,227.83
本期利润	-996,586.56
加权平均基金份额本期利润	-0.0231
本期加权平均净值利润率	-2.29%
本期基金份额净值增长率	-2.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	-75,002.19
期末可供分配基金份额利润	-0.0027
期末基金资产净值	28,148,262.45
期末基金份额净值	0.9973
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-0.27%

注：1. 本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3. 所述期末基金业绩指标不包含持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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

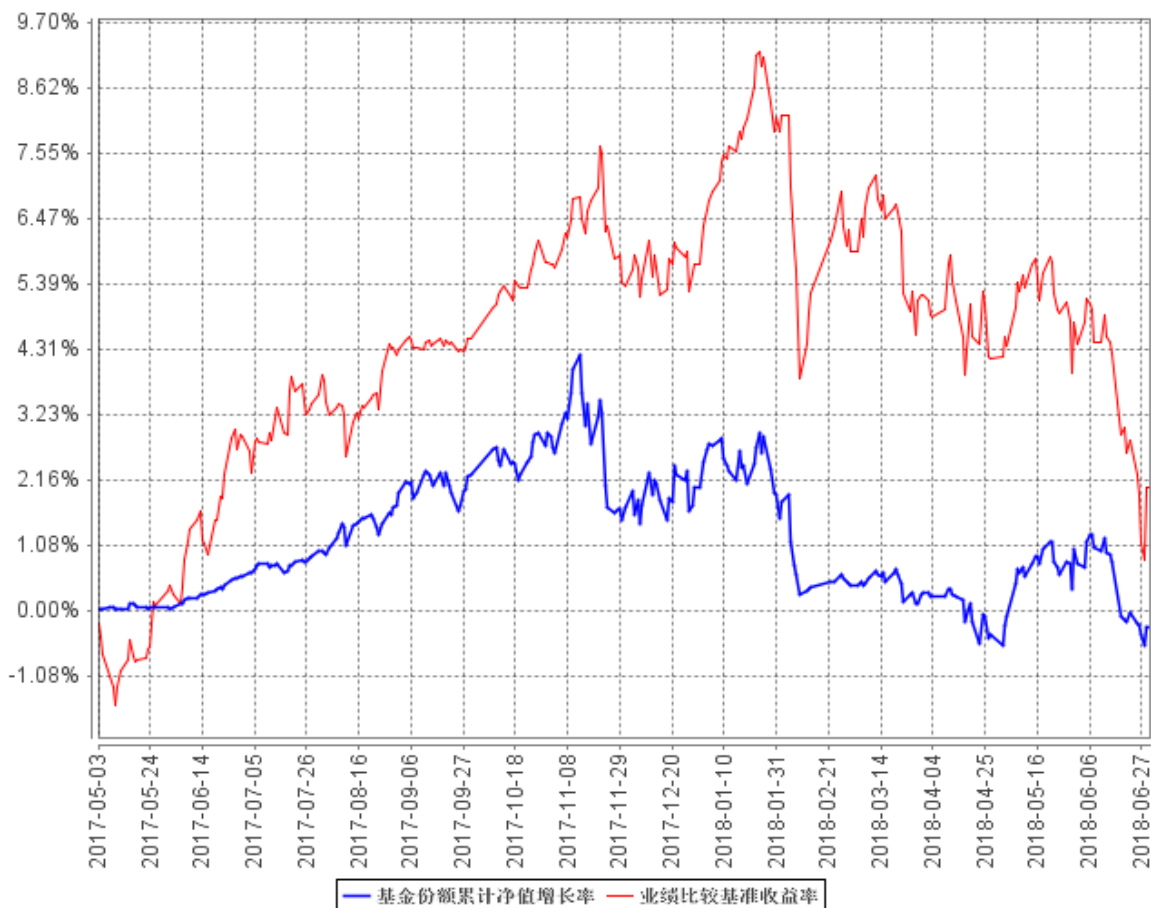
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.28%	0.26%	-2.59%	0.50%	1.31%	-0.24%
过去三个月	-0.55%	0.25%	-2.99%	0.45%	2.44%	-0.20%
过去六个月	-2.26%	0.23%	-3.48%	0.46%	1.22%	-0.23%
过去一年	-0.84%	0.24%	-0.79%	0.37%	-0.05%	-0.13%
自基金合同	-0.27%	0.22%	2.04%	0.36%	-2.31%	-0.14%



生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.3 其他指标

注：无

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国都证券股份有限公司（以下简称“国都证券”）是由国都证券有限责任公司整体变更而来。国都证券有限责任公司是经中国证监会批准，在中诚信托有限责任公司和北京国际信托有限公司原有证券业务整合的基础上，吸收其他股东出资，于 2001 年 12 月 28 日成立的综合性证券公司，注册地为北京。2015 年 6 月 23 日公司组织形式由有限责任公司整体变更为股份有限公司，公司正式更名为“国都证券股份有限公司”，注册资本变更为 460000.0009 万元。2015 年 12 月 31 日完成增资扩股，注册资本增至 530000.0009 万元。

2014 年 8 月 19 日，经中国证监会批准，公司获准开展公募基金管理业务资格，截至 2018 年 6 月 30 日，本公司管理 7 只开放式证券投资基金——国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金、国都聚益定期开放混合型证券投资基金、国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金、国都智能制造混合型发起式证券投资基金、国都量化精选混合型证券投资基金、国都多策略混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张小强	基金经理	2017 年 5 月 3 日	-	7 年	硕士，曾任中国畜牧兽医学学会信息与市场研究部分析师，天相投资顾问有限公司分析师，国都证券研究所分析师，负责农业、食品等消费品行业研究。现任国都证券基金管理部基金经理。
杨鹏飞	基金经理	2017 年 6 月 29 日	-	6 年	经济学硕士，曾任中航证券有限公司金融研究所债券研究员、高级债券研究员，中航证券有限公司融资理财部高级投资经理。现任国都证券基金管理部

					基金经理。
尹德才	基金经 理	2017 年 5 月 18 日	-	6 年	硕士，2011 年加入天相投资顾问有限公司证券部研究员，2013 年加入国都证券任研究所化工行业研究员、基金管理部高级行业研究员、基金经理助理，现任国都证券基金管理部基金经理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规的规定和《国都聚益定期开放混合型证券投资基金基金合同》等有关法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资运作符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

从上半年宏观运行情况来看，经济保持了一定韧性，GDP 增长 6.8%，总量增长较为稳定，但有两个因素对未来经济增长形成压力，一个是贸易摩擦发酵程度不断加深，对经济增长造成持续扰动，另一个是领先指标社会融资增速下降较快。受此影响，市场对未来经济放缓的预期加重，也加大了对企业盈利的担忧。政策层面，一方面在金融防风险的大方针下，结构性去杠杆政策坚持推进，再融资市场流动性出现大面积枯竭。另一方面，货币政策保持稳健中性，但预调微调加强，采用中长期 MLF 投放、下调存款准备金率等多种货币工具，用宽货币对冲结构性信用紧缩，导致无风险利率下行与信用溢价上行并存。受贸易摩擦、股票质押以及信用紧缩等因素影响，A 股上半年下跌较多。债券市场方面，经济放缓预期与资金面宽松下，利率债、高等级信用债表现较好，低等级信用债表现较差，债券违约时有发生。

本基金坚持稳健操作，考虑紧信用下债券违约风险加重，债券投资以利率债、高等级债券为主，随着资金面宽松的确认，逐渐拉长利率债投资久期。股票方面，年初仓位偏高，贸易摩擦发生后，增强了仓位的灵活度，同时，沿着业绩确定性高、现金流好、估值较为合理的方向精选个股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2018 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.9973 元，份额累计净值 0.9973 元，半年度基金份额净值增长率-2.26%，同期基金业绩比较基准-3.48%，本基金份额净值增长率高于业绩比较基准 1.22 个百分点。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计随着“7.23”国常会的政策推进与落实，社融和信贷有望改善，有助于缓解经济下滑趋势，从而支持企业盈利表现。而随着资管新规边际放松和融资平台公司合理融资需求受到保障，预示后续再融资市场将较上半年明显改善，信用债总体违约风险或下降，但僵尸企业再融资依然困难，仍需警惕负债率畸高、盈利能力较差的企业债券出现违约风险。

本基金将继续秉持稳健投资的运作思想，在无风险利率已经下降较多、信用风险将缓未缓的阶段，仍旧以稳健方式投资债券；而在股票市场大幅下跌之后，部分优质股票的投资价值较为突出，积极寻找具有阿尔法的公司。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格，同时，根据公司制定的相关制度，估值工作决策会议成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形；截至报告期末，本基金资产净值仍低于五千万元。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国都聚益定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	554,395.35	382,506.68
结算备付金		344,578.86	1,449,730.35
存出保证金		28,702.57	30,099.06
交易性金融资产	6.4.7.2	22,198,694.46	50,265,654.60
其中：股票投资		1,003,730.00	14,889,468.00
基金投资		-	-
债券投资		21,194,964.46	35,376,186.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	5,000,025.00	2,000,010.00
应收证券清算款		701,752.93	1,029,701.99
应收利息	6.4.7.5	223,452.98	920,374.48
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		29,051,602.15	56,078,077.16
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		773,721.44	104,409.29
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		20,289.50	37,834.20
应付托管费		4,057.90	7,566.86
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	11,619.34	29,785.24

应交税费		350.22	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	93,301.30	130,000.00
负债合计		903,339.70	309,595.59
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	28,223,264.64	54,651,265.05
未分配利润	6.4.7.10	-75,002.19	1,117,216.52
所有者权益合计		28,148,262.45	55,768,481.57
负债和所有者权益总计		29,051,602.15	56,078,077.16

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9973 元，基金份额总额 28,223,264.64 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国都聚益定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 5 月 3 日(基 金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-550,029.71	1,894,582.02
1.利息收入		637,516.85	1,591,471.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	22,210.43	387,567.30
债券利息收入		476,694.40	438,132.32
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		138,612.02	765,772.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-874,795.05	-130,131.50
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-999,420.32	-150,769.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	74,353.20	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	50,272.07	20,638.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-338,358.73	433,241.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	25,607.22	-



<b>减：二、费用</b>		446,556.85	437,929.54
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	174,101.49	322,662.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	34,820.27	64,532.41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	158,791.98	18,571.31
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		80.15	-
7. 其他费用	6.4.7.20	78,762.96	32,163.82
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-996,586.56	1,456,652.48
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-996,586.56	1,456,652.48

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国都聚益定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	54,651,265.05	1,117,216.52	55,768,481.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-996,586.56	-996,586.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-26,428,000.41	-195,632.15	-26,623,632.56
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-26,428,000.41	-195,632.15	-26,623,632.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益(基金净值)	28,223,264.64	-75,002.19	28,148,262.45
项目	上年度可比期间 2017年5月3日(基金合同生效日)至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	253,397,096.03	-	253,397,096.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,456,652.48	1,456,652.48
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	253,397,096.03	1,456,652.48	254,853,748.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>赵远峰</u>	<u>李蔚</u>	<u>封欣</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国都聚益定期开放混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2017 年 1 月 3 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予国都聚益定期开放混合型证券投资基金注册的批复》证监许可〔2017〕4 号文核准注册，自 2017 年 4 月 5 日至 2017 年 4 月 26 日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集

253,329,318.79 元人民币，并经中准会计师事务所（特殊普通合伙）“中准验字[2017]第 1044 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《国都聚益定期开放混合型证券投资基金合同》于 2017 年 5 月 3 日正式生效。

基金合同生效日的基金份额总额为 253,397,096.03 份基金单位，其中认购资金利息折合 67,777.24 份基金单位。

本基金基金管理人为国都证券股份有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国都聚益定期开放混合型证券投资基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券（包括可分离交易可转债）、可交换债券）、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、国债期货、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 3 号〈半年度报告的内容与格式〉》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日，期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30

日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估值与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(3) 存款利息收入不征收增值税。

(4) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(5) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(6) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从公开发行和转让市场取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(7) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(8) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	554,395.35
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	554,395.35

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,007,927.22	1,003,730.00	-4,197.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	21,033,885.67	21,194,964.46
	银行间市场	-	-
	合计	21,033,885.67	21,194,964.46
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	22,041,812.89	22,198,694.46	156,881.57

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,000,025.00	-
银行间市场	-	-
合计	5,000,025.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购余额，故未存在因此取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	288.77
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	155.10
应收债券利息	223,690.84
应收资产支持证券利息	-

应收买入返售证券利息	-694.73
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	13.00
合计	223,452.98

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	11,619.34
银行间市场应付交易费用	-
合计	11,619.34

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	93,301.30
合计	93,301.30

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	54,651,265.05	54,651,265.05
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-26,428,000.41	-26,428,000.41
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-

本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	28,223,264.64	28,223,264.64

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,760,932.03	-643,715.51	1,117,216.52
本期利润	-658,227.83	-338,358.73	-996,586.56
本期基金份额交易产生的变动数	-680,659.68	485,027.53	-195,632.15
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-680,659.68	485,027.53	-195,632.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	422,044.52	-497,046.71	-75,002.19

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	14,864.71
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,043.55
其他	302.17
合计	22,210.43

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	54,724,821.93
减：卖出股票成本总额	55,724,242.25
买卖股票差价收入	-999,420.32



**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	74,353.20
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	74,353.20

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	46,713,957.45
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	45,494,191.55
减：应收利息总额	1,145,412.70
买卖债券差价收入	74,353.20

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期间无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金在本报告期末进行贵金属投资。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金在本报告期无买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金在本报告期无贵金属赎回差价收入。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金在本报告期无贵金属申购差价收入。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金在本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金在本报告期其他投资差价收入。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	50,272.07
基金投资产生的股利收益	-
合计	50,272.07

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-338,358.73
——股票投资	-477,216.26
——债券投资	138,857.53
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估	-

增值税	
合计	-338,358.73

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	25,607.22
合计	25,607.22

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	158,791.98
银行间市场交易费用	-
合计	158,791.98

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	13,116.39
信息披露费	37,851.57
银行划款手续费	195.00
账户维护费	27,000.00
查询服务费	600.00
合计	78,762.96

#### 6.4.7.21 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其

配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金未发生需要披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国都证券股份有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金的证券经纪商
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年5月3日(基金合同生效日)至2017 年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国都证券股份有限公	97,040,542.44	100.00%	15,211,833.98	100.00%

司				
---	--	--	--	--

### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年5月3日(基金合同生效日)至2017 年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
国都证券股份有限	70,245,555.67	100.00%	-	-

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年5月3日(基金合同生效日)至2017 年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
国都证券股份有	768,400,000.00	100.00%	2,748,400,000.00	100.00%

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比区间均未通过关联方交易单元进行涉及支付关联方费用的权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国都证券股份有 限公司	98,724.57	100.00%	11,619.34	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年5月3日(基金合同生效日)至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国都证券股份有	41,857.86	100.00%	13,354.13	100.00%

限公司				
-----	--	--	--	--

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等。

2、关联方符合本基金管理人选择证券经营机构、使用其交易单元作为基金专用交易单元的标准。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年5月3日(基金合同生效日)至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	174,101.49	322,662.00
其中：支付销售机构的客户维护费	59,821.52	129,833.31

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，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 个工作日内从基金资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，顺延至最近可支付日支付。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年5月3日(基金合同生效日) 至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	34,820.27	64,532.41

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.16%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.16\% \div \text{当年天数}$$

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 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金其他关联方在本报告期末未持有本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年5月3日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	554,395.35	14,864.71	3,151,405.02	108,922.54

注：1、本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在承销期内未参与关联方承销证券交易。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### 6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300146	汤臣倍健	2018 年 1 月 31 日	重大资产重组	16.60	2018 年 7 月 31 日	16.50	15,000	224,200.00	249,000.00	-

注：本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大资产重组可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人根据发展战略、经营目标及资本实力制定风险管理政策，确定风险偏好、风险容忍度、风险限额等指标，在确保整体风险可承受的前提下，积极、恰当地管理风险，实现经风险调整后的收益最大化。

本基金管理人风险管理的组织体系由董事会、监事会、经营管理层、各部门、分支机构、子



公司和全体工作人员组成。董事会承担公司全面风险管理的最终责任。监事会承担全面风险管理的监督责任。经营管理层对公司全面风险管理承担主要责任。公司各部门、分支机构及子公司负责人承担本部门（分支机构、子公司）风险管理的直接责任。公司全体工作人员对风险管理有效性承担勤勉尽责、审慎防范、及时报告的责任。

董事会及其风险控制委员会负责审批公司风险管理制度、风险管理政策、重大风险处置方案等重大风险管理事项，对公司承担风险的整体情况和风险管理体系的有效性进行监督。

监事会负责监督董事会和经营管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。

经营管理层及其合规与风险管理委员会负责建设公司全面风险管理体系，组织实施董事会通过的风险管理政策，在董事会授权范围内对风险管理重大事项进行决策，向董事会报告风险管理工作 and 风险承担状况并接受监督。管理层及其下属的专业决策机构具体管理公司各项业务，设定各业务限额和风险限额，确定业务管理和风险控制的制度和措施。首席风险官负责公司全面风险管理工作，并领导风险管理部的工作。

风险管理部在首席风险官领导下履行公司全面风险管理职责。公司资金管理部门牵头负责公司流动性风险管理工作，公司相关部门和风险管理部门配合其开展工作。

各业务部门、分支机构、子公司履行本部门（分支机构、子公司）的风险管理工作职责。财务、信息技术、运营、人力资源等职能部门在做好本部门风险管理工作的同时，在各自的专业领域对业务部门进行监督。

公司全体工作人员在执业行为中履行各自的风险管理责任。

#### **6.4.13.2 信用风险**

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本报告期末，本基金未持有资产支持证券。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：本报告期末，本基金未持有同业存单。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本报告期末，本基金未持有资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本报告期末，本基金未持有同业存单。

#### 6.4.13.3 流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

##### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金组合资产以现金、股票、债券、7 日内到期的国债逆回购等高流动性资产为主，停牌股票等主动投资于流动性受限资产占基金资产净值比例未超过 15%，7 个工作日可变现资产市值占基金净值的比例维持在 80%以上，可流通股票资产变现天数低于 1 天，单一投资者持有基金份额最高比例不超过 20%。

报告期内，未出现巨额赎回或延期支付赎回款的情况及 7 个工作日可变现资产的可变现价值低于每日净赎回金额的情况，未出现可能导致流动性风险的情形，相关流动性监控指标符合《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》。

#### 6.4.13.4 市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

##### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致证券价格波动而产生风险。

##### 2、经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

##### 3、购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收

益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

#### 4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

金融市场利率波动会导致证券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于证券，收益水平会受到利率变化的影响。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	554,395.35	-	-	-	-	-	554,395.35
结算备付金	344,578.86	-	-	-	-	-	344,578.86
存出保证金	28,702.57	-	-	-	-	-	28,702.57
交易性金融资产	-	-	12,103,748.68	9,091,215.78	-	1,003,730.00	22,198,694.46
买入返售金融资产	5,000,000.00	-	-	-	-	25.00	5,000,025.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	701,752.93	701,752.93
应收利息	-	-	-	-	-	223,452.98	223,452.98
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,927,676.78	-	12,103,748.68	9,091,215.78	-	1,928,960.91	29,051,602.15
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	773,721.44	773,721.44
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	20,289.50	20,289.50
应付托管费	-	-	-	-	-	4,057.90	4,057.90
应付交易费用	-	-	-	-	-	11,619.34	11,619.34
应交税费	-	-	-	-	-	350.22	350.22
其他负债	-	-	-	-	-	93,301.30	93,301.30
负债总计	-	-	-	-	-	903,339.70	903,339.70
利率敏感度缺口	5,927,676.78	-	12,103,748.68	9,091,215.78	-	1,025,621.21	28,148,262.45
上年度末 2017年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	382,506.68	-	-	-	-	-	382,506.68

结算备付金	1,449,730.35	-	-	-	-	1,449,730.35
存出保证金	30,099.06	-	-	-	-	30,099.06
交易性金融资产	-	-20,762,222.40	14,613,964.20	-	-14,889,468.00	50,265,654.60
买入返售金融资产	2,000,000.00	-	-	-	10.00	2,000,010.00
应收证券清算款	-	-	-	-	1,029,701.99	1,029,701.99
应收利息	-	-	-	-	920,374.48	920,374.48
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,862,336.09	-20,762,222.40	14,613,964.20	-	-16,839,554.47	56,078,077.16
负债	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	104,409.29	104,409.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	37,834.20	37,834.20
应付托管费	-	-	-	-	7,566.86	7,566.86
应付交易费用	-	-	-	-	29,785.24	29,785.24
其他负债	-	-	-	-	130,000.00	130,000.00
负债总计	-	-	-	-	309,595.59	309,595.59
利率敏感度缺口	3,862,336.09	-20,762,222.40	14,613,964.20	-	-16,529,958.88	55,768,481.57

注：1、表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	94,962.49	57,990.40
	市场利率上升 25 个基点	-94,962.49	-57,990.40

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本

基金所持有的证券价格实施监控。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,003,730.00	3.57	14,889,468.00	26.70
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	21,194,964.46	75.30	35,376,186.60	63.43
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	22,198,694.46	78.86	50,265,654.60	90.13

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动		
	Beta 系数以市场过去一年的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足一年的股票，默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数下跌 5%	-127,613.60	-783,863.50
	沪深 300 指数上涨 5%	127,613.60	783,863.50

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：本基金在 95%的置信水平，以过去一年为风险样本观察期，计算前瞻天数为 1 天的风险价值。

本期末本基金风险价值为 63,617.60 元，占基金资产净值比例为 0.23%。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 836,602.00 元，属于第二层次的余额为 21,362,092.46 元，无属于第三层次的余额。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），本基金采用第三方估值机构根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值确定为第二层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	1,003,730.00	3.45
	其中：股票	1,003,730.00	3.45
2	固定收益投资	21,194,964.46	72.96
	其中：债券	21,194,964.46	72.96
	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	5,000,025.00	17.21
	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	898,974.21	3.09
7	其他各项资产	953,908.48	3.28
8	合计	29,051,602.15	100.00

注：由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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	-	-
C	制造业	1,003,730.00	3.57
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	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	1,003,730.00	3.57

注：以上行业分类以 2018 年 06 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 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	600195	中牧股份	20,000	389,000.00	1.38
2	600519	贵州茅台	500	365,730.00	1.30
3	300146	汤臣倍健	15,000	249,000.00	0.88

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 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	000998	隆平高科	1,079,354.00	1.94
2	600519	贵州茅台	938,575.00	1.68
3	000639	西王食品	926,690.00	1.66
4	601398	工商银行	894,350.00	1.60
5	600398	海澜之家	862,637.00	1.55
6	600195	中牧股份	853,860.00	1.53



7	002491	通鼎互联	763,700.00	1.37
8	000786	北新建材	720,882.00	1.29
9	002327	富安娜	716,400.00	1.28
10	000895	双汇发展	683,886.00	1.23
11	600977	中国电影	666,000.00	1.19
12	603609	禾丰牧业	646,902.00	1.16
13	600004	白云机场	617,950.00	1.11
14	601933	永辉超市	616,180.00	1.10
15	002281	光迅科技	572,830.00	1.03
16	600048	保利地产	555,750.00	1.00
17	300133	华策影视	555,200.00	1.00
18	002470	金正大	534,150.00	0.96
19	600612	老凤祥	518,950.00	0.93
20	600030	中信证券	496,190.00	0.89

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	002327	富安娜	1,182,199.00	2.12
2	000998	隆平高科	1,097,105.00	1.97
3	600004	白云机场	1,072,239.00	1.92
4	600398	海澜之家	1,067,471.00	1.91
5	000513	丽珠集团	954,216.00	1.71
6	000639	西王食品	948,774.00	1.70
7	601398	工商银行	818,900.00	1.47
8	600030	中信证券	766,120.00	1.37
9	000977	浪潮信息	731,521.00	1.31
10	002491	通鼎互联	727,150.00	1.30
11	000786	北新建材	697,700.00	1.25
12	600048	保利地产	684,920.00	1.23
13	000895	双汇发展	656,340.00	1.18
14	603609	禾丰牧业	644,381.00	1.16
15	600977	中国电影	637,452.00	1.14

16	601628	中国人寿	634,810.00	1.14
17	300136	信维通信	631,955.00	1.13
18	002557	洽洽食品	616,219.00	1.10
19	601933	永辉超市	607,490.00	1.09
20	600519	贵州茅台	602,168.00	1.08

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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	42,315,720.51
卖出股票收入（成交）总额	54,724,821.93

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,839,650.24	13.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,289,565.54	54.32
	其中：政策性金融债	15,289,565.54	54.32
4	企业债券	1,983,876.68	7.05
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	81,872.00	0.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,194,964.46	75.30

### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开 1701	100,000	10,038,000.00	35.66
2	018006	国开 1702	52,700	5,251,565.54	18.66

3	010107	21 国债(7)	37,570	3,839,650.24	13.64
4	127326	15 国网 05	10,000	998,692.00	3.55
5	136469	16 联通 01	9,980	985,184.68	3.50

### 7.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 7.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以对冲系统性风险为目的，达到套期保值目的。基金管理人动态调整股指期货合约持仓品种、持仓数量，与现货相匹配，控制风险，并驻留相对收益。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在综合分析经济基本面、资金面和政策面的基础上，结合组合内各利率债持仓结构的基础上，按照“利率风险评估—套期保值比例计算—保证金、期现价格变化等风险控制”的流程，

构建并实时调整利率债的套期保值组合。同时，结合套利策略和投机策略等多种交易策略，优化资产配置，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本报告期末，本基金未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本报告期，本基金投资的前十名证券的发行主体未出现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。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 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	28,702.57
2	应收证券清算款	701,752.93
3	应收股利	-
4	应收利息	223,452.98
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	953,908.48

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	------	--------------

1	110031	航信转债	81,872.00	0.29
---	--------	------	-----------	------

### 7.12.5 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	300146	汤臣倍健	249,000.00	0.88	重大资产重组

注：本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大资产重组可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
876	32,218.34	49,545.45	0.18%	28,173,719.19	99.82%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	0.00	0.0000%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年5月3日）基金份额总额	253,397,096.03
本报告期期初基金份额总额	54,651,265.05
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	26,428,000.41
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	28,223,264.64

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

因基金管理人的总经理常喆辞职，根据基金管理人第一届董事会第十八次会议决议，自 2018 年 6 月 6 日起，常喆先生不再担任基金管理人公司总经理职务，由现任公司副总经理赵远峰先生（现分管公募基金管理业务）在法定期限内（即不超过 6 个月）代为履行总经理职责。基金管理人已在指定报刊及网站公告该事项，并向中国证监会北京监管局进行报备。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金财产的诉讼；涉及基金管理人的其他未决诉讼均不会对基金管理人日常经营造成重大影响，亦不会对基金管理人履行基金管理职责造成影响。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是中准会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	股票交易	应支付该券商的佣金



	交易单元 数量	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	备注
国都证券	2	97,040,542.44	100.00%	98,724.57	100.00%	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
国都证券	70,245,555.67	100.00%	768,400,000.00	100.00%	-	-

### 10.8 其他重大事件

注：本基金已出现基金合同约定的进行基金财产清算并终止的情形，我公司已于 2018 年 7 月 11 日在指定报刊及网站发布《关于国都聚益定期开放混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，公告基金合同终止及基金财产清算等事项。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金管理人国都证券股份有限公司（简称“公司”）2018 年第一次临时股东大会决议，选举吴京林、何于军、翁振杰、李峰、吕益民、陈文博、陈海宁、周立业、黄磊、黄俞为我公司第二届董事会非独立董事，选举王晓艳、李敬伟、雷达为第二届董事会独立董事。

新当选董事（拟任）在其任职资格经证券监管部门核准后正式任职。本次董事人员的变动属于我公司正常的换届工作，符合《公司法》及公司《章程》的有关规定，对公司公募基金管理业务及基金份额持有人的合法权益不存在重大不利影响。

公司已于 2018 年 2 月 6 日通过指定报刊和公司官网等媒介披露了相关公告。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《国都聚益定期开放混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 2、《国都聚益定期开放混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《国都聚益定期开放混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站 [www.guodu.com](http://www.guodu.com)

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.guodu.com](http://www.guodu.com)）查阅。

国都证券股份有限公司

2018年8月24日