国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2019年第1号

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
二零一九年一月

重要提示

本基金于2016年11月16日经中国证券监督管理委员会《关于准予国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016] 2725号）核准注册募集。

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申请的注册，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做出实质性判断或者保证。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所蕴含的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于中等预期收益风险水平的投资品种。

投资有风险，投资者认购或申购基金份额时应当认真阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件，了解本基金的风险收益特征，自主判断基金的投资价值，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资者的风险承受能力相符，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

投资者应当通过本基金管理人或其他销售机构认购、申购和赎回基金。本基金在募集期内按1.00元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按1.00元面值认购基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破1.00元、从而遭受损失的风险。

本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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。

本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负担。

第一部分 基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1、基本信息

名称：国都证券股份有限公司
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层10层
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层10层
法定代表人：王少华
成立日期：2001年12月28日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监机构字[2001]309号
公募基金管理业务资格批文及文号：中国证监会证监许可[2014]854号
注册资本：530000.0009万元人民币
存续期间：持续经营
电话：010-84183333
传真：010-84183311

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品业务；公开募集证券投资基金管理业务。

股权结构：

序号	股东名称	增资后持股比例(%)
1	中诚信托有限责任公司	13.33
2	北京国际信托有限公司	9.59
3	国华能源投资有限公司	7.69
4	山东海洋集团有限公司	5.13
5	东方创业投资管理有限责任公司	5.13

（以上为前五大股东，截至2018年6月30日）

2、部门设置情况

国都证券股份有限公司产品与业务审核委员会对包含基金在内的各类金融产品和业务（含基金管理业务、资产管理业务、创新业务、柜台业务等）的开发、销售和运作的重大事项进行审议和决策。国都证券股份有限公司设立了公募证券投资基金管理业务投资决策委员会对基金投资的重大事项进行集体决策。基金管理部负责公募证券投资基金业务。基金管理部分别设有投资部、研究部、运营部和中央交易室四个二级部门：投资部负责公募基金的投资运作，具体包括行业和上市股票投资，固定收益市场的投资，以及其他投资品种的研究和投资业务；研究部负责根据经济、政策、股市情况，为投资部提供投资策略，并负责对各基金产品进行绩效评价；运营部负责根据监管机构及产品合同的要求对产品信息进行披露、传达、解读监管机构的各项政策；中央交易室负责根据证监会、交易所、协会以及公司的相关法规和管理办法，负责各公募基金产品的日常交易与复核工作。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

王军先生，董事，本科。曾在上海市崇明县马桥公社插队；上海市第二商业局财务处主任科员；上海商联房地产公司总会计师。现任东方创业投资管理有限责任公司总经理、国都证券股份有限公司董事。

李玲女士，董事，博士。曾任山东省石油化学工业厅副主任科员；中共山东省委企业工作委员会副主任科员、主任科员；山东省人民政府国有资产监督管理委员会主任科员、副调研员；泰安市发展和改革委员会副主任、党组副书记；山东海洋集团有限公司战略发展部部长、战略发展与信息数据中心总经理；现任山东海洋集团有限公司监事、董事会办公室主任、党群工作部部长、国都证券股份有限公司董事。

何于军先生，董事，硕士。曾任职于北京市地质调查研究院测绘部；曾任华通会计师事务所审计二部部门经理；利安达信隆会计师事务所证券业务三部部门经理；国华能源投资有限公司风险控制部副总经理；国华能源投资有限公司风险控制部总经理。现任国华能源投资有限公司风险控制部副总经理兼法律事务部总经理、国都证券股份有限公司董事。

吴京林先生，董事，硕士。曾任北京市审计局科员；北京国际信托有限公司财务部会计主管；北京国际信托有限公司稽核审计部经理助理、部门副经理、部门经理；北京国际信托有限公司计划财务部经理；北京国际信托有限公司副总会计师兼计划财务部经理、资产运营部经理。现任北京国际信托有限公司总会计师、国都证券股份有限公司董事。

翁振杰先生，董事，硕士。曾任解放军通信学院教官，北京中关村科技发展（控股）股份有限公司副总经理，重庆国际信托股份有限公司董事、首席执行官、董事长兼首席执行官，重庆三峡银行股份有限公司董事长、西南证券股份有限公司董事长、益民基金管理有限公司董事长等职务；现任重庆国际信托股份有限公司董事长、国都证券股份有限公司董事。

王晓艳女士，独立董事，本科。曾任职北京煤炭管理干部学院财务管理系财会教研室主任；中国矿业大学经济系财会教研室主任。现任中国传媒大学经济与管理学院经济与管理学院副教授、工商系主任、国都证券股份有限公司独立董事。

龚志忠先生，独立董事，硕士研究生。曾在云南省轻工业学校担任教师；四通集团公司任法务部副部长。现任北京市嘉润道和律师事务所合伙人、国都证券股份有限公司独立董事。

荆霞女士，独立董事，硕士。曾在中国人民大学第一分校财会系担任讲师。现任中国人民大学财政金融学院副教授、国都证券股份有限公司独立董事。

李敬伟先生，独立董事，硕士研究生。现任对外经贸大学国际经济研究院教师（副研究员）、北京嘉润律师事务所从事兼职律师、国都证券股份有限公司独立董事。

2、监事会成员

江厚强先生，监事会主席，硕士。曾任职于中国五金交电化工公司财务部员工、期货部副总经理；广州证券有限责任公司北京投行部经理；富邦资产管理有限公司董事、副总经理；天风证券有限责任公司副总经理兼北方期货经纪有限公司董事长；航天科技财务有限责任公司投资业务副总经理。现任国都证券股份有限公司监事会主席。

韩新梅女士，监事，本科。曾任北京市海淀区东升红艺铝制品厂主管会计；北京市海淀区京海农工商公司会计兼统计；北京市海淀区欣华农工商公司副总经理、财务经理、行政管理副主任。现任北京市海淀区欣华农工商公司监事会主任、国都证券股份有限公司监事。

彭铭巧女士，监事，硕士。曾任黑龙江省证券公司深圳营业部职员；特区时空杂志社职员；国泰君安证券海口营业部职员；海航集团有限公司证券业务部研究室经理；海航集团财务有限公司投资银行部理财主管。现任渤海国际信托有限公司证券投资部总经理，国都证券股份有限公司监事。

王玉江先生，监事，硕士。曾任邯郸矿务局王凤矿财务副科长、科长，邯郸矿业集团有限公司结算中心会计、副主任、主任；河北金牛能源集团有限责任公司产权与资本运营部长。现任冀中能源集团有限责任公司产权资本运营部长、冀中能源邢台矿业集团有限责任公司总会计师、国都证券股份有限公司监事。

操家明先生，监事，本科。曾任安徽省蚌埠市饲料公司财务主管会计；安徽省蚌埠市粮食局财务管理副科长，上海市腾达智能系统有限公司财务、投资经理；宏润建设集团股份有限公司总会计师。现任深圳市远为投资有限公司财务总监、国都证券股份有限公司监事。

陈跃武先生，监事，硕士。曾任人行北京市分行职工中专学校；北京银行学校教师，国家外汇管理局北京分局科员，人行北京市分行副处长，北京国际信托投资有限公司总经理助理、证券总部副总经理。现任国都证券股份有限公司研究所副所长、国都证券股份有限公司职工监事。

陈志红女士，监事，硕士。曾在国家外汇管理局从事外事工作、经常项目及IC管理工作；中煤信托投资有限责任公司证券总部副总经理。现任国都证券股份有限公司人力资源部经理、国都证券股份有限公司职工监事。

3、高级管理人员

赵远峰先生，总经理，硕士。曾任机电部自动化研究所助理工程师；华夏证券股份有限公司历任信息系统维护工程师、东四营业部信息技术主管；国都证券电脑中心总经理、信息技术总监、风险控制部总经理兼风控总监、经纪业务总监、副总经理。现任国都证券股份有限公司总经理。

刘仲哲先生，副总经理，硕士。曾任安徽财贸学院计算中心教师；南方证券有限公司营业部经理；中煤信托投资有限责任公司证券业务筹建负责人、证券总部副总经理。现任国都证券股份有限公司副总经理。

刘中先生，副总经理，博士。曾任中国核仪器设备总公司干部；华夏证券公司发行部营销处处长；南方证券有限公司投资银行部副总经理；国信证券有限责任公司投资银行总部执行副总经理。现任国都证券股份有限公司副总经理。

曲宏先生，副总经理，博士。曾任铁道部科学研究院运输及经济研究所科管室副主任、副研究员；铁道部财务司职员；中国国际金融有限公司投行经理；国家开发银行投资银行业务组投行综合业务负责人；南方证券股份公司投资银行总部副总经理、债券业务总部总经理；河北省国际信托公司副董事长、总裁；国都证券总裁助理。现任国都证券股份有限公司副总经理。

魏泽鸿先生，副总经理、合规总监兼首席风险官，硕士。曾任中国农业银行北京分行职员；中国证券市场研究设计中心部门经理；中煤信托投资有限责任公司长阳路营业部总经理；国都证券经纪业务总部总经理兼经纪业务总监、合规与风险控制部总经理兼风控总监。现任国都证券股份有限公司副总经理、合规总监、首席风险官。

李蔚女士，财务负责人，本科。曾任上海远东证券有限责任公司主管会计；光大投资有限责任公司主管会计；中煤信托投资有限责任公司证券总部计划财务部总经理；国都证券计划财务部副总经理、结算存管部总经理、计划财务部总经理。现任国都证券股份有限公司财务负责人。

朱玉萍女士，董事会秘书，本科。曾任空军部队战士、学员、区队长、新闻干事；北京国际信托投资公司证券总部办公室主任、营业部经理；中工信托投资公司证券部副总经理、重庆营业部总经理；北京国际信托投资公司证券总部办公室主任。现任国都证券股份有限公司董事会秘书。

4、本基金基金经理

张崴女士，硕士研究生，2007年5月加入国都证券，历任国都证券有限责任公司经纪业务总部、国都证券有限责任公司研究所地产行业研究员、电气设备及新能源行业研究员。现任国都证券股份有限公司基金管理部基金经理、公募证券投资基金管理业务投资决策委员会成员。

杨鹏飞先生，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，国都证券股份有限公司基金管理部基金经理。

5、公募证券投资基金管理业务投资决策委员会成员

廖晓东先生，北京工商大学经济学硕士。曾任中煤信托投资有限责任公司证券总部项目经理；加入国都证券后历任研究所副总经理、证券投资部总经理、研究所所长。现任国都证券股份有限公司基金管理部总经理、公募证券投资基金管理业务投资决策委员会主席。

游典宗先生，经济学硕士。2011年加入国都证券，历任资产管理总部行业研究员、投资经理助理。现任基金管理部基金经理、公募证券投资基金管理业务投资决策委员会成员。

杨志刚先生，厦门大学经济系硕士。曾任中国证券报编辑；中航证券有限公司研究所高级销售经理；2011年加入国都证券，任旅游、家电行业研究员，现为基金管理部基金经理助理、公募证券投资基金管理业务投资决策委员会成员。

程广飞先生，中科院研究生院工学硕士，北京科技大学计算机学士。2011年毕业加入中国国际金融有限公司创新产品部担任分析师，随后任光大证券股份有限公司量化研究员，2013年加入国都证券，担任研究所金融工程研究员、金融工程组负责人。现任基金管理部基金经理、公募证券投资基金管理业务投资决策委员会成员。

张崴女士，简历同上。

上述人员无近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，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、转换和登记事宜；
2、办理基金备案手续；
3、对所管理的不同基金资产分别管理、分别记账，进行证券投资；
4、按照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收益；
5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
6、编制季度、半年度和年度基金报告；
7、计算并公告基金资产净值和基金份额累计净值，确定基金份额申购、赎回价格；
8、办理与基金资产管理业务活动有关的信息披露事项；
9、召集基金份额持有人大会；
10、保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
11、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者实施其他法律行为；
12、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守相关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

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，建立健全的内部控制制度，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资产从事证券投资；
（2）不公平地对待其管理的不同基金资产；
（3）利用基金资产或者职位之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
（5）侵占、挪用基金资产；
（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规定禁止的其它行为。

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，不得将基金资产用于以下投资或活动：
（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它不正当的证券交易活动；
（6）正在实施的有效法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其它行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4、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）不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其它活动。

（五）基金管理人内部控制制度

1、内部控制制度概述

为加强内部控制，防范和化解风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，公司已建立健全内部控制体系和内部控制制度。

公司内部控制制度由基本管理制度和部门业务规章等部分组成。基本管理制度包括投资管理、信息披露、信息技术管理、公司财务管理、基金会计、人力资源管理、资料档案管理、业绩评估考核、监察稽核、风险控制、紧急应变等制度。部门业务规章是对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等具体说明。

2、内部控制的原则
（1）健全性原则：内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；
（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，维护内控制度的有效执行；
（3）独立性原则：公司各机构、部门和岗位在职能上必须保持相对独立；
（4）相互制约原则：组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。
（5）成本效益原则：运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、内部控制组织体系
（1）公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设审计与合规委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。
（2）公募证券投资基金管理业务投资决策委员会为基金投资管理的最高决策机构，由基金管理部总经理、部门负责人（投资总监）、基金经理及研究部负责人组成，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。
（3）合规负责人积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。
（4）内控部门：公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证内控部门的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确合规法律部、风险管理部、稽核审计部及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。合规法律部、风险管理部、稽核审计部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。
（5）业务部门：部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。
（6）岗位员工：公司努力树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到基金管理业务各个部门、各个岗位和各个环节。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责任，并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

4、内部控制措施
（1）公司确立积极吸收或采用先进的风险控制技术和手段，进行内部控制和风险管理。公司逐步健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。
（2）公司设置的组织结构，充分体现职责明确、相互制约的原则，各部门均有明确的授权分工，操作相互独立。公司逐步建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。
（3）公司设立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：
①各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；
②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡。
（4）公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。
（5）公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。
（6）授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容包括：
①股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；
②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责；
③重大业务授权采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效；
④对已获授权的部门和人员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。
（7）建立完善的基金财务核算与基金资产估值系统和资产分离制度，基金资产与公司自有资产、其他委托资产以及不同基金的资产之间实行独立运作，分别核算，及时、准确和完整地反映基金资产的状况。
（8）建立科学、严格的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员的重叠。投资、研究、交易、IT等重要业务部门和岗位进行物理隔离。
（9）建立和维护信息管理系统，严格信息管理，保证客户资料等信息安全、真实和完整。积极维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统，各级领导、部门及员工均有明确的报告途径。
（10）建立和完善客户服务标准，加强基金销售管理，规范基金宣传推介，不得有不正当销售行为和不正当竞争行为。
（11）制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序，对发生严重影响基金份额持有人利益、可能引起系统性风险、严重影响社会稳定的突发事件，按照预案妥善处理。
（12）公司建立健全内部监控制度，合规负责人、内控部门对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实；定期评价内部控制的有效性并适时改进。
①对公司各项制度、业务的合法合规性核查。由内控部门设计各部门监察稽核点明细，按照查核项目和查核程序进行部门自查、监察部核查，确保公司各项制度、业务符合有关法律、行政法规、部门规章及行业监管规则。
②对内部风险控制制度的持续监督。由内控部门与风险管理部组织相关业务部门、岗位共同识别风险点，界定风险责任人，设计内部风险点自我评估表，对风险点进行评估和分析，并由内控部门与风险管理部监督风险控制措施的执行，及时防范和化解风险。
③合规负责人发现公司存在重大风险或者有违法违规行为，在告知总经理和其他有关高级管理人员的同时，向董事会、中国证监会和公司所在地中国证监会派出机构报告。

5、基金管理人关于内部控制制度的声明

本基金管理人确知建立、维持、完善、实施和有效执行风险管理和内部控制制度是本基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任。本基金管理人特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确、完备，并承诺将根据市场环境的变化和业务的发展不断完善内部控制制度。

第二部分 基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）
注册地址：福州市湖东路154号
办公地址：上海市江宁路168号
法定代表人：高建平
成立时间：1988年8月22日
注册资本：207.74亿元人民币
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74号
托管部门联系人：张小燕
电话：021-52629999
传真：021-62159217

2、发展概况及财务状况

兴业银行成立于1988年8月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本207.74亿元。

开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至 2017年12月31日，兴业银行资产总额达6.42万亿元，实现营业收入1399.75亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润572.00亿元。根据2017年英国《银行家》杂志“全球银行1000强”排名，兴业银行按一级资本排名第28位，按总资产排名第30位，跻身全球银行30强。按照美国《财富》杂志“世界500强”最新榜单，兴业银行以426.216亿美元总营收排名第230位。同时，过去一年在国内外权威机构组织的各项评比中，先后获得“亚洲卓越商业银行”“年度最佳股份制银行”“中国最受尊敬企业”等多项殊荣。

3、主要人员情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理及产品研发处、养老金管理中心等处室，共有员工100余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

4、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74号。截至2018年12月31日，本行共托管证券投资基金248只，托管基金的基金资产净值合计8964.38亿元，基金份额合计亿8923.86亿份。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明

1.内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2.内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3.内部风险控制原则
（1）全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。
（2）独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。
（3）相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。
（4）定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。
（5）防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。
（6）有效性原则。内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，
内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；
（7）审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险，审慎经营，保证托管资产的安全
与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设；
（8）责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

（三）内部控制制度及措施
1、制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。
2、建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。
3、风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。
4、相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。
5、人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。
6、应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

（四）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

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人有违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，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。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

第三部分 相关服务机构

（一）基金份额发售机构

名称：国都证券股份有限公司
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦九层十层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦九层十层
法定代表人：王少华
客服电话：400-818-8118
网址：www.guodu.com

其他销售机构情况详见本基金的相关公告。基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（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：010-58598853
传真：010-58598907
联系人：任瑞新

（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
注册地址：上海市银城中路68号19楼
办公地址：上海市银城中路68号19楼
负责人：俞卫锋
联系电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：陆奇
经办律师：黎明、陆奇

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：中准会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址：北京市海淀区首体南路22号楼4层04D
办公地址：北京市海淀区首体南路22号楼4层04D
执行事务合伙人：田雍
联系电话：010-88354846
传真：010-88354834
联系人：武维社
经办注册会计师：关晓光、田雍

第四部分 基金的名称

国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金

第五部分 基金的类型

契约型开放式

第六部分 基金的投资目标

在谨慎投资的前提下，本基金力争超越业绩比较基准，追求基金资产的稳健增值。

第七部分 基金的投资范围

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。

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的60%，但在每个开放期的前1个月和后1个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制；权证投资比例不得超过基金资产净值的3%；在开放期，每个交易日日终在扣除国债期货合约及股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；在封闭期，本基金不受前述5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约及股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

第八部分 基金的投资策略

1、资产配置策略。

本基金跟踪和分析宏观经济数据，通过定性与定量分析，对经济形势及未来发展趋势进行判断，据此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，力争投资组合的稳定增值。

2、债券投资策略

本基金将在保持组合低波动性的前提下，运用多种积极管理增值策略，追求资本金保值的同时，持续性地以绝对正回报的方式实现增值。以久期策略和杠杆策略作为债券投资的基本策略，将债券组合久期与封闭期相匹配，在资金相对充裕的情况下，使用基础组合持有的债券进行回购放大融入短期资金滚动操作，获取超额稳定收益。同时，基金将辅以积极增值策略，包括并不限于收益率曲线策略、债券类属配置策略、骑乘策略、相对价值策略、信用利差策略等，在谨慎投资的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

可转债投资策略：可转债不同于一般的企业债券，其投资人具有在一定条件下转股、回售的权利，因此其理论价值等于作为普通债券的基础价值加上可转债内含选择权的价值。本基金投资于可转债，主要目标是降低基金净值的下行风险，基金投资的可转债可以转股，以保留参与股票升值的收益潜力。

3、股票投资策略

本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的分析方法进行股票投资。基金管理人在行业分析的基础上，选择治理结构完善、经营稳健、业绩优良、具有可持续增长前景或价值被低估的上市公司股票，以合理价格买入并进行中长期投资。本基金股票投资具体包括行业分析与配置、公司财务状况评价、价值评估及股票选择与组合优化等过程。

本基金将对业绩增长平稳、股息率持续较高、现金流充裕的股票进行重点筛选和行配置，在控制风险的前提下力求获取绝对收益。

4、股指期货投资策略

本基金的股指期货投资以对冲系统性风险为目的，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，优化资产配置，谨慎投资，以降低投资组合的整体风险，达到套期保值的目标。

5、国债期货投资策略

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。

6、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

7、权证投资策略

本基金的权证投资以控制风险、平滑收益、锁定利润为主要目的。本基金通过对权证标的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑其的流动性，谨慎投资。

8、开放期投资策略

本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。

第九部分 基金的业绩比较基准

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%。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A股市场总体发展趋势。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于2001年12月31日推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势，测算债券投资回报率水平，判断债券供求动向提供了很好的依据。

本基金认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整实施前2个工作日在指定媒介上予以公告。

第十部分 基金的风险收益特征

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。

第十一部分 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年1月18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。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	–	–
	其中：股票	–	–
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	158,463,077.71	37.78
	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	260,431,964.08	62.10
8	其他资产	495,707.29	0.12
9	合计	419,390,749.08	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末，本基金未持有股票。
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
报告期末，本基金未持有股票。
4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
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债券投资明细
报告期末，本基金未持有债券。
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十名资产支持证券投资明细
报告期末，本基金未持有资产支持证券。
7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
报告期末，本基金未持有贵金属投资。
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明细
报告期末，本基金未持有权证。
9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期内，本基金未参与股指期货交易。
10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期内，本基金未参与国债期货交易。
11. 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本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。
(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。
(3)其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	35,457.78
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	460,249.51
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	495,707.29

(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。

第十二部分 基金的业绩

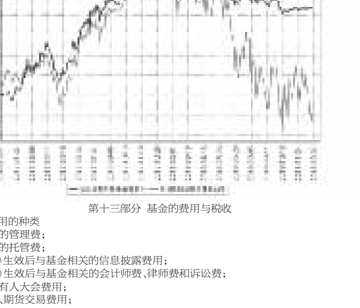
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、自基金合同生效以来至2018年12月31日，本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

阶段	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
2016年12月21日至2016年12月31日	0.09%	0.02%	0.99%	0.24%	–0.90%	–0.22%
2017年1月1日至2017年12月31日	7.66%	0.21%	5.54%	0.26%	2.12%	–0.05%
2018年1月1日至2018年12月31日	–2.13%	0.15%	–7.24%	0.53%	5.11%	–0.38%

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

国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：
（2016年12月21日至2018年12月31日）



第十三部分 基金的费用与税收

（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、基金的账户开户费用、账户维护费用；
9、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0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H=E\times 0.8\%\div$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、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0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H=E\times 0.22\%\div$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。

上述“（一）基金费用的种类中第3－9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
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；
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）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，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

本招募说明书根据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定，并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动，对本基金管理人于2018年8月4日刊登的《国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金招募说明书（更新）》进行了更新，主要更新内容如下：

（一）“第三部分基金管理人”、“第四部分基金托管人”、“第九部分基金的投资”、“第十部分基金的业绩”、“第二十二部分其它应披露事项”。

国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2019年第1号

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
二零一九年一月

重要提示

本基金于2015年11月11日经中国证券监督管理委员会《关于准予国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]2577号文）核准注册募集。

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申请的注册，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。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所蕴含的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，具有中等预期收益风险水平的投资品种。

投资者认购或申购基金份额时应当认真阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件，了解本基金的风险收益特征，自主判断基金的投资价值，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资者的风险承受能力相符，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本基金的投资范围包括中小企业私募债券，中小企业私募债券的规模一般小额零散，主要通过固定收益平台综合电子平台、综合协议交易平台或证券公司进行转让，难以进行更广泛估值和询价，因此中小企业私募债券的估值价格可能与实际变现的市场价格有一定的偏差而对本基金资产净值造成影响。同时中小企业私募债券流动性可能比较匮乏，因此可能面临较高的流动性风险，以及由流动性较差变现成本较高而使基金净值受损的风险。

投资者应当通过本基金管理人或其他销售机构认购、申购和赎回基金。本基金在募集期内按1.00元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按1.00元面值认购基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破1.00元，从而遭受损失的风险。

本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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。

本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负担。

第一部分 基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1、基本信息

名称：国都证券股份有限公司
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层10层
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层10层
法定代表人：王少华
成立日期：2001年12月28日
批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监机构字[2001]309号
公募基金管理业务资格批文及文号：中国证监会证监许可[2014]854号
注册资本：530000.0009万元
存续期间：持续经营
电话：010-84183333
传真：010-84183311

公司经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品业务；公开募集证券投资基金管理业务。

国都证券股份有限公司无任何重大违规记录。

股权结构：

序号	股东名称	增资后持股比例(%)
1	中诚信托有限责任公司	13.33
2	北京国际信托有限公司	9.59
3	国华能源投资有限公司	7.69
4	山东海洋集团有限公司	5.13
5	东方创业投资管理有限责任公司	5.13

（以上为前五大股东，数据截止至2018年6月30日）

2、部门设置情况

国都证券股份有限公司产品与业务审核委员会对包含基金在内的各类金融产品和业务（含基金管理业务、资产管理业务、创新业务、柜台业务等）的开发、销售和运作的重大事项进行审议和决策。国都证券股份有限公司设立了公募证券投资基金管理业务投资决策委员会对基金投资的重大事项进行集体决策。基金管理部负责公募证券投资基金业务。基金管理部分别设有投资部、研究部、运营部和中央交易室四个二级部门：投资部负责公募基金的投资运作，具体包括行业和上市股票投资，固定收益市场的投资，以及其他投资品种的研究和投资业务；研究部负责根据经济、政策、股市情况，为投资部提供投资策略，并负责对各基金产品进行绩效评价；运营部负责根据监管机构及产品合同的要求对产品信息进行披露、传达、解读监管机构的各项政策；中央交易室负责根据证监会、交易所、协会以及公司的相关法规和管理办法，负责各公募基金产品的日常交易与复核工作。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

王军先生，董事，本科。曾在上海市崇明县马桥公社插队；上海市第二商业局财务处主任科员；上海商联房地产公司总会计师。现任东方创业投资管理有限责任公司总经理、国都证券股份有限公司董事。

李玲女士，董事，博士。曾任山东省石油化学工业厅副主任科员；中共山东省委企业工作委员会副主任科员、主任科员；山东省人民政府国有资产监督管理委员会主任科员、副调研员；泰安市发展和改革委员会副主任、党组副书记；山东海洋集团有限公司战略发展部部长、战略发展与信息数据中心总经理；现任山东海洋集团有限公司监事、董事会办公室主任、党群工作部部长、国都证券股份有限公司董事。

何于军先生，董事，硕士。曾任职于北京市地质调查研究院测绘部；曾任华通会计师事务所审计二部部门经理；利安达信隆会计师事务所证券业务三部部门经理；国华能源投资有限公司风险控制部副总经理；国华能源投资有限公司风险控制部总经理。现任国华能源投资有限公司风险控制部副总经理兼法律事务部总经理、国都证券股份有限公司董事。

吴京林先生，董事，硕士。曾任北京市审计局科员；北京国际信托有限公司财务部会计主管；北京国际信托有限公司稽核审计部经理助理、部门副经理、部门经理；北京国际信托有限公司计划财务部经理；北京国际信托有限公司副总会计师兼计划财务部经理、资产运营部经理。现任北京国际信托有限公司总会计师、国都证券股份有限公司董事。

翁振杰先生，董事，硕士。曾任解放军通信学院教官，北京中关村科技发展（控股）股份有限公司副总经理，重庆国际信托股份有限公司董事、首席执行官、董事长兼首席执行官，重庆三峡银行股份有限公司董事长、西南证券股份有限公司董事长、益民基金管理有限公司董事长等职务；现任重庆国际信托股份有限公司董事长、国都证券股份有限公司董事。

王晓艳女士，独立董事，本科。曾任职北京煤炭管理干部学院财务管理系财会教研室主任；中国矿业大学经济系财会教研室主任。现任中国传媒大学经济与管理学院经济与管理学院副教授、工商系主任、国都证券股份有限公司独立董事。

龚志忠先生，独立董事，硕士研究生。曾在云南省轻工业学校担任教师；四通集团公司任法务部副部长。现任北京市嘉润道和律师事务所合伙人、国都证券股份有限公司独立董事。

荆霞女士，独立董事，硕士。曾在中国人民大学第一分校财会系担任讲师。现任中国人民大学财政金融学院副教授、国都证券股份有限公司独立董事。

李敬伟先生，独立董事，硕士研究生。现任对外经贸大学国际经济研究院教师（副研究员）、北京嘉润律师事务所从事兼职律师、国都证券股份有限公司独立董事。

2、监事会成员

江厚强先生，监事会主席，硕士。曾任职于中国五金交电化工公司财务部员工、期货部副总经理；广州证券有限责任公司北京投行部经理；富邦资产管理有限公司董事、副总经理；天风证券有限责任公司副总经理兼北方期货经纪有限公司董事长；航天科技财务有限责任公司投资业务副总经理。现任国都证券股份有限公司监事会主席。

韩新梅女士，监事，本科。曾任北京市海淀区东升红艺铝制品厂主管会计；北京市海淀区京海农工商公司会计兼统计；北京市海淀区欣华农工商公司副总经理、财务经理、行政管理副主任。现任北京市海淀区欣华农工商公司监事会主任、国都证券股份有限公司监事。

彭铭巧女士，监事，硕士。曾任黑龙江省证券公司深圳营业部职员；特区时空杂志社职员；国泰君安证券海口营业部职员；海航集团有限公司证券业务部研究室经理；海航集团财务有限公司投资银行部理财主管。现任渤海国际信托有限公司证券投资部总经理，国都证券股份有限公司监事。

王玉江先生，监事，硕士。曾任邯郸矿务局王凤矿财务副科长、科长，邯郸矿业集团有限公司结算中心会计、副主任、主任；河北金牛能源集团有限责任公司产权与资本运营部长。现任冀中能源集团有限责任公司产权资本运营部长、冀中能源邢台矿业集团有限责任公司总会计师、国都证券股份有限公司监事。

操家明先生，监事，本科。曾任安徽省蚌埠市饲料公司财务主管会计；安徽省蚌埠市粮食局财务管理副科长，上海市腾达智能系统有限公司财务、投资经理；宏润建设集团股份有限公司总会计师。现任深圳市远为投资有限公司财务总监、国都证券股份有限公司监事。

陈跃武先生，监事，硕士。曾任人行北京市分行职工中专学校；北京银行学校教师，国家外汇管理局北京分局科员，人行北京市分行副处长，北京国际信托投资有限公司总经理助理、证券总部副总经理。现任国都证券股份有限公司研究所副所长、国都证券股份有限公司职工监事。

陈志红女士，监事，硕士。曾在国家外汇管理局从事外事工作、经常项目及IC管理工作；中煤信托投资有限责任公司证券总部副总经理。现任国都证券股份有限公司人力资源部经理、国都证券股份有限公司职工监事。

3、高级管理人员

赵远峰先生，总经理，硕士。曾任机电部自动化研究所助理工程师；华夏证券股份有限公司历任信息系统维护工程师、东四营业部信息技术主管；国都证券电脑中心总经理、信息技术总监、风险控制部总经理兼风控总监、经纪业务总监、副总经理。现任国都证券股份有限公司总经理。

刘仲哲先生，副总经理，硕士。曾任安徽财贸学院计算中心教师；南方证券有限公司营业部经理；中煤信托投资有限责任公司证券业务筹建负责人、证券总部副总经理。现任国都证券股份有限公司副总经理。

刘中先生，副总经理，博士。曾任中国核仪器设备总公司干部；华夏证券公司发行部营销处处长；南方证券有限公司投资银行部副总经理；国信证券有限责任公司投资银行总部执行副总经理。现任国都证券股份有限公司副总经理。

曲宏先生，副总经理，博士。曾任铁道部科学研究院运输及经济研究所科管室副主任、副研究员；铁道部财务司职员；中国国际金融有限公司投行经理；国家开发银行投资银行业务组投行综合业务负责人；南方证券股份公司投资银行总部副总经理、债券业务总部总经理；河北省国际信托公司副董事长、总裁；国都证券总裁助理。现任国都证券股份有限公司副总经理。

魏泽鸿先生，副总经理、合规总监兼首席风险官，硕士。曾任中国农业银行北京分行职员；中国证券市场研究设计中心部门经理；中煤信托投资有限责任公司长阳路营业部总经理；国都证券经纪业务总部总经理兼经纪业务总监、合规与风险控制部总经理兼风控总监。现任国都证券股份有限公司副总经理、合规总监、首席风险官。

李蔚女士，财务负责人，本科。曾任上海远东证券有限责任公司主管会计；光大投资有限责任公司主管会计；中煤信托投资有限责任公司证券总部计划财务部总经理；国都证券计划财务部副总经理、结算存管部总经理、计划财务部总经理。现任国都证券股份有限公司财务负责人。

朱玉萍女士，董事会秘书，本科。曾任空军部队战士、学员、区队长、新闻干事；北京国际信托投资公司证券总部办公室主任、营业部经理；中工信托投资公司证券部副总经理、重庆营业部总经理；北京国际信托投资公司证券总部办公室主任。现任国都证券股份有限公司董事会秘书。

4、本基金基金经理

游典宗先生，经济学硕士。2011年加入国都证券，历任资产管理总部行业研究员、投资经理助理。现任基金管理部基金经理、公募证券投资基金管理业务投资决策委员会成员。

5、公募证券投资基金管理业务投资决策委员会成员

廖晓东先生，北京工商大学经济学硕士。曾任中煤信托投资有限责任公司证券总部项目经理；加入国都证券后历任研究所副总经理、证券投资部总经理、研究所所长。现任国都证券股份有限公司基金管理部总经理、公募证券投资基金管理业务投资决策委员会主席。

张崴女士，硕士。历任国都证券有限责任公司经纪业务总部、国都证券有限责任公司研究所地产行业研究员、电气设备及新能源行业研究员。现任国都证券股份有限公司基金管理部基金经理、公募证券投资基金管理业务投资决策委员会成员。

杨志刚先生，厦门大学经济系硕士。曾任中国证券报编辑；中航证券有限公司研究所高级销售经理；2011年加入国都证券，任旅游、家电行业研究员，现为基金管理部基金经理助理、公募证券投资基金管理业务投资决策委员会成员。

程广飞先生，中科院研究生院工学硕士，北京科技大学计算机学士。2011年毕业加入中国国际金融有限公司创新产品部担任分析师，随后任光大证券股份有限公司量化研究员，2013年加入国都证券，担任研究所金融工程研究员、金融工程组负责人。现任基金管理部基金经理、公募证券投资基金管理业务投资决策委员会成员。

游典宗先生，简历同上。

上述人员无近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其它机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回、转换和登记事宜；
2、办理基金备案手续；
3、对所管理的不同基金资产分别管理、分别记账，进行证券投资；
4、按照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收益；
5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
6、编制季度、半年度和年度基金报告；
7、计算并公告基金资产净值和基金份额累计净值，确定基金份额申购、赎回价格；
8、办理与基金资产管理业务活动有关的信息披露事项；
9、召集基金份额持有人大会；
10、保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表和其它相关资料；
11、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者实施其它法律行为；
12、有关法律法规和中国证监会规定的其它职责。

（四）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守相关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

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，建立健全的内部控制制度，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资产从事证券投资；
（2）不公平地对待其管理的不同基金资产；
（3）利用基金资产或者职位之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
（5）侵占、挪用基金资产；
（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规定禁止的其它行为。

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，不得将基金资产用于以下投资或活动：
（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它不正当的证券交易活动；
（6）正在实施的有效法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其它行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4、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）不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其它活动。

（五）基金管理人内部控制制度

1、内部控制制度概述

为加强内部控制，防范和化解风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，公司已建立健全内部控制体系和内部控制制度。

公司内部控制制度由基本管理制度和部门业务规章等部分组成。基本管理制度包括投资管理、信息披露、信息技术管理、公司财务管理、基金会计、人力资源管理、资料档案管理、业绩评估考核、监察稽核、风险控制、紧急应变等制度。部门业务规章是对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等具体说明。

2、内部控制的原则
（1）健全性原则：内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；
（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，维护内控制度的有效执行；
（3）独立性原则：公司各机构、部门和岗位在职能上必须保持相对独立；
（4）相互制约原则：组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。
（5）成本效益原则：运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、内部控制组织体系
（1）公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设审计与合规委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。
（2）公募证券投资基金管理业务投资决策委员会为基金投资管理的最高决策机构，由基金管理部总经理、部门负责人（投资总监）、基金经理及研究部负责人组成，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。
（3）合规负责人积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。
（4）内控部门：公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证内控部门的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确合规法律部、风险管理部、稽核审计部及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。合规法律部、风险管理部、稽核审计部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。
（5）业务部门：部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。
（6）岗位员工：公司努力树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到基金管理业务各个部门、各个岗位和各个环节。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责任，并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

4、内部控制措施
（1）公司确立积极吸收或采用先进的风险控制技术和手段，进行内部控制和风险管理。公司逐步健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。
（2）公司设置的组织结构，充分体现职责明确、相互制约的原则，各部门均有明确的授权分工，操作相互独立。公司逐步建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。
（3）公司设立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：
①各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；
②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡。
（4）公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。
（5）公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。
（6）授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容包括：
①股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；
②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责；
③重大业务授权采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效；
④对已获授权的部门和人员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。
（7）建立完善的基金财务核算与基金资产估值系统和资产分离制度，基金资产与公司自有资产、其他委托资产以及不同基金的资产之间实行独立运作，分别核算，及时、准确和完整地反映基金资产的状况。
（8）建立科学、严格的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员的重叠。投资、研究、交易、IT等重要业务部门和岗位进行物理隔离。
（9）建立和维护信息管理系统，严格信息管理，保证客户资料等信息安全、真实和完整。积极维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统，各级领导、部门及员工均有明确的报告途径。
（10）建立和完善客户服务标准，加强基金销售管理，规范基金宣传推介，不得有不正当销售行为和不正当竞争行为。
（11）制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序，对发生严重影响基金份额持有人利益、可能引起系统性风险、严重影响社会稳定的突发事件，按照预案妥善处理。
（12）公司建立健全内部监控制度，合规负责人、内控部门对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实；定期评价内部控制的有效性并适时改进。
①对公司各项制度、业务的合法合规性核查。由内控部门设计各部门监察稽核点明细，按照查核项目和查核程序进行部门自查、监察部核查，确保公司各项制度、业务符合有关法律、行政法规、部门规章及行业监管规则。
②对内部风险控制制度的持续监督。由内控部门与风险管理部组织相关业务部门、岗位共同识别风险点，界定风险责任人，设计内部风险点自我评估表，对风险点进行评估和分析，并由内控部门与风险管理部监督风险控制措施的执行，及时防范和化解风险。
③合规负责人发现公司存在重大风险或者有违法违规行为，在告知总经理和其他有关高级管理人员的同时，向董事会、中国证监会和公司所在地中国证监会派出机构报告。

5、基金管理人关于内部控制制度的声明

本基金管理人确知建立、维持、完善、实施和有效执行风险管理和内部控制制度是本基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任。本基金管理人特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确、完备，并承诺将根据市场环境的变化和业务的发展不断完善内部控制制度。

第二部分 基金托管人

（一）基金托管人情况

1.基本情况

名称：兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）
注册地址：福州市湖东路154号
办公地址：上海市江宁路168号
法定代表人：高建平
成立时间：1988年8月22日
注册资本：207.74亿元人民币
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74号
托管部门联系人：张小燕
电话：021-52629999
传真：021-62159217

2.发展概况及财务状况

兴业银行成立于1988年8月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本207.74亿元。

开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至 2017年12月31日，兴业银行资产总额达6.42万亿元，实现营业收入1399.75亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润572.00亿元。根据2017年英国《银行家》杂志“全球银行1000强”排名，兴业银行按一级资本排名第28位，按总资产排名第30位，跻身全球银行30强。按照美国《财富》杂志“世界500强”最新榜单，兴业银行以426.216亿美元总营收排名第230位。同时，过去一年在国内外权威机构组织的各项评比中，先后获得“亚洲卓越商业银行”“年度最佳股份制银行”“中国最受尊敬企业”等多项殊荣。

3.主要人员情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理及产品研发处、养老金管理中心等处室，共有员工100余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

4.基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74号。截至2018年12月31日，本行共托管证券投资基金248只，托管基金的基金资产净值合计8964.38亿元，基金份额合计亿8923.86亿份。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明

1.内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2.内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3.内部风险控制原则
（1）全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。
（2）独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。
（3）相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。
（4）定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。
（5）防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。
（6）有效性原则。内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，
内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；
（7）审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险，审慎经营，保证托管资产的安全
与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设；
（8）责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

（三）内部控制制度及措施
1、制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。
2、建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。
3、风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。
4、相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。
5、人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。
6、应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

（四）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

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人有违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，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。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

第三部分 相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、销售机构
名称：国都证券股份有限公司
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦九层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦九层
法定代表人：王少华
客服电话：400-818-8118
网址：www.guodu.com

2、兴业银行股份有限公司
注册地址：福建省福州市湖东路154号
办公地址：福建省福州市湖东路154号
法定代表人：高建平
客服电话：95561
网址：www.cib.com.cn

3、华福证券有限责任公司
客服电话：400-889-6326
网址：www.gfhfzq.com.cn

4、深圳众禄基金销售股份有限公司
客服电话：400-678-8887
网址：www.zlfund.cn

5、泰诚财富基金销售（大连）有限公司
客服电话：400-641-1999
网址：www.taichengcaifu.com

6、上海天天基金销售有限公司
客服电话：400-181-8188
网址：fund.eastmoney.com

7、和讯信息科技有限公司
客服电话：400-920-0022
网址：licaike.hexun.com

8. 珠海盈米基金销售有限公司
客服电话020-89629066
网址：www.yingmi.cn

9、广发银行股份有限公司
客服电话：400-830-8003
网址：www.cgbchina.com.cn

10、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
客服电话：400-166-1188
网址：www.new-rand.cn

其他销售机构情况详见本基金的相关公告。基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（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：010-58598853
传真：010-58598907
联系人：任瑞新

（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
注册地址：上海市银城中路68号19楼
办公地址：上海市银城中路68号19楼
负责人：俞卫锋
联系电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：陆奇
经办律师：黎明、陆奇

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：中准会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址：北京市海淀区首体南路22号楼4层04D
办公地址：北京市海淀区首体南路22号楼4层04D
执行事务合伙人：田雍
联系电话：010-88354831
传真：010-88354834
联系人：董雁蕊
经办注册会计师：关晓光、田雍

第四部分 基金的名称

国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

第五部分 基金的类型

契约型开放式

第六部分 基金的投资目标

在有效控制风险、保持良好流动性的前提下，积极主动管理，追求基金的长期稳健增值。

第七部分 基金的投资范围

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、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、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。

基金的投资组合比例为：本基金对股票的投资比例为基金资产的0-95%，权证投资比例不得超过基金资产净值的3%，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，现金或者到期日在一年以内的政府债券的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、存出保证金和应收申购款等；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

第八部分 基金的投资策略

本基金以宏观分析为基础，结合各行业的演绎特征，确定阶段性重点行业，由行业研究团队加以重点覆盖。行业研究员重点对所覆盖的行业及个股的成长性及估值水平做出独立的判断和评级，精选优质个股作为构建组合的基础。一方面，基金管理人通过研究中国经济所处新常态下各行业在新形势下的转型和升级，结合宏观经济政策和导向，寻找中国当期阶段最受益的核心重点行业；另一方面，研究团队会对重点行业跟踪竞争格局的变化，把握产业演进和升级过程中，行业龙头盈利能力提升的投资机会。

1、大类资产配置策略

本基金运用自上而下和自下而上相结合的方法进行大类资产配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的行业与个股分析有机结合进行前瞻性的决策。综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素，制定本基金资产的大类资产配置比例。

2、股票投资策略

本基金在准确把握整个宏观策略为前提下，秉承成长性是决定超额回报的核心理念，坚持成长性资产作为本基金配置的核心资产，结合个股与行业精选相结合，寻找出表现优异的子行业和优质的个股。

（1）以成长为核心精选行业

本基金以创新型成长类资产作为核心配置资产，从新技术驱动、新产品引入、市场开拓、商业模式创新入手寻找一些未来能够驱动中国经济增长的“主导产业”。例如：互联网+、工业4.0、智能制造、高端装备、新材料、新能源、生物技术等。

此外，本基金也关注传统产业转型升级带来的成长性投资机会。不同国家和地区，因经济周期、经济结构、地域等因素差异，传统行业也会出现阶段性成长。如中国90年代的百货、家电，2000年后持续城镇化带来房产、汽车及与此相关的重化工行业阶段性高成长。未来，我们重点挖掘汽车后市场、房地产后市场、体育文化、保健养老等行业。

（2）行业配置

在行业配置方面，本基金基于经济运行周期、经济转型方向、政策导向以及各种创新驱动因素，优选成长性行业，结合行业景气度、行业整体估值、涨跌偏离度、风格变化及择时模型，优化配置各行业的权重。

股票组合建立后，本基金会进一步根据组合中个股价格波动、估值水平、特殊事件等，动态调整个股权重，使股票组合的整体风险处于可控范围内。

（3）个股选择

本基金在选择个股时关注如下几个方面：

1）基本面

管理人将自上而下与自下而上相结合，优选成长性行业与主题投资机会。股票研究团队重点覆盖，从行业空间、核心优势、公司治理等多方面进行研究。

2）估值水平

本基金注重个股估值水平研究，将以独有的成长性估值模型考察个股成长性和估值的匹配程度，如果估值低估或比较合理，就会选择买入并坚持持有，相反如果估值已透支了未来几年的业绩增长预期，即业绩增长的速度与股价和市盈率不相匹配，那么就会相应减持这种股票

3、固定收益投资策略

固定收益投资主要用于提高非股票资产的收益率，基金管理人将坚持价值投资的理念，严格控制风险，追求合理的回报。

本基金在债券投资方面，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，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

基金管理人的债券研究团队会密切关注通胀、利率、期限、流动性、税收等因素，实时的确定各债券品种的公允价值。通过配置不同类别和期限的债券品种，达到债券组合的收益率目标。

4、中小企业私募债券投资策略

由于中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。在进行投资时，将采取分散投资、锁定收益策略。在遴选债券时，将只投资有担保或者国有控股企业发行的中小企业私募债，以降低信用风险。

5、股指期货投资策略

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。

6、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

7、权证投资策略

本基金的权证投资以控制风险、平滑收益、锁定利润为主要目的。本基金通过对权证标的的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑其的流动性，谨慎投资。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A 股市场总体发展趋势。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于2001年12月31日推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势，测算债券投资回报率水平，判断债券供求动向提供了很好的依据。

本基金认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整实施前2个工作日在指定媒介上予以公告。

第十部分 基金的风险收益特征

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。

第十一部分 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年1月18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。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	22,085,185.00	75.51
	其中：股票	22,085,185.00	75.51
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	–	–
	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	7,128,366.84	24.37
8	其他资产	35,460.92	0.12
9	合计	29,249,012.76	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	12,813,315.00	44.23
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	870,020.00	3.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,247,400.00	4.31
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,819,550.00	6.28
J	金融业	4,651,700.00	16.06
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	683,200.00	2.36
S	综合	–	–
	合计	22,085,185.00	76.23

注：以上行业分类以2018年12月31日的证监会行业分类标准为依据。

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	002470	金正大	221,000	1,396,720.00	4.82
2	601688	华泰证券	80,000	1,296,000.00	4.47
3	002415	海康威视	50,000	1,288,000.00	4.45
4	600299	安迪苏	110,000	1,262,800.00	4.36
5	002236	大华股份	110,000	1,260,600.00	4.35
6	600419	天润乳业	90,000	1,238,400.00	4.27
7	600030	中信证券	70,000	1,120,700.00	3.87
8	600999	招商证券	70,000	938,000.00	3.24
9	600271	航天信息	40,000	915,600.00	3.16
10	601336	新华保险	20,000	844,800.00	2.92

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
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债券投资明细
报告期末，本基金未持有债券。
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十名资产支持证券投资明细
报告期末，本基金未持有资产支持证券。
7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
报告期末，本基金未持有贵金属投资。
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明细
报告期末，本基金未持有权证。
9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期内，本基金未参与股指期货交易。
10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期内，本基金未参与国债期货交易。
11. 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本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。
(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。
(3)其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	31,312.65
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	3,551.85
5	应收申购款	596.42
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	35,460.92

(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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600030	中信证券	1,120,700.00	3.87	筹划发行股份购买资产

注：本基金截至2018年12月31日止持有以上因公布的重大事项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。

第十二部分 基金的业绩

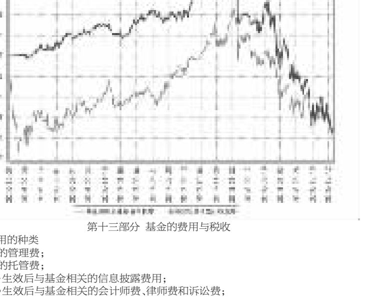
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、自基金合同生效以来至2018年12月31日，本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

阶段	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
2015年12月28日至2015年12月31日	0.00%	0.00%	–2.21%	1.30%	2.21%	–1.30%
2016年1月1日至2016年12月31日	4.80%	0.26%	–9.11%	1.12%	13.91%	–0.86%
2017年1月1日至2017年12月31日	9.72%	0.51%	16.15%	0.51%	–6.43%	0.00%
2018年1月1日至2018年12月31日	–27.12%	1.16%	–19.57%	1.07%	–7.55%	0.09%

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

国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：
（2015年12月28日至2018年12月31日）



第十三部分 基金的费用与税收

（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、基金的账户开户费用、账户维护费用；
9、因交易需要而产生的能明确由基金财产承担的第三方服务费用；
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它费用。

（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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H=E\times 1.5\%\div$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、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：

$H=E\times 0.25\%\div$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。

上述“（一）基金费用的种类中第3－9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
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；
4、其它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）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，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

本招募说明书根据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定，并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动，对本基金管理人于2018年8月4日刊登的《国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）》进行了更新，主要更新内容如下：

（一）“第三部分基金管理人”、“第四部分基金托管人”、“第九部分基金的投资”、“第五部分相关服务机构”、“第十部分基金的业绩”、“第二十二部分其他应披露事项”。