

# 国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金

## 2018年度报告摘要

基金基本情况 | 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 | 报告期内：2018年1月1日至2018年12月31日

### \$ 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，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由基金董事签发。

本报告期内，公司通过日常监控核对与事前控制的方式，不断提高和完善监察稽核工作的效率和质量，提高从业人员的风险意识水平，切实保证基金运作所涉及的各个环节均能按照法律法规和公司内部制度有效落实。

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

本基金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。

本报告期内的财务数据经审计，中准会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金份额持有人权益增加。

本报告期自2018年1月1日起至2018年12月31日止。

### \$ 2 基金简介

#### 2.1 基金基本情况

基金简称 | 国都聚鑫定期开放

基金代码 | 000866

基金运作方式 | 约定开放式

基金合同生效日 | 2016年12月21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 | 397,094,968.00份

基金合同存续期 | 不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 | 在谨慎投资的前提下，本基金力争超越行业平均水平，实现基金资产的增值。

投资策略 | 本基金将坚持“价值投资”理念，通过行业分析、对行业景气度的把握以及对个股的深入研究，选择估值合理且具有持续增长潜力的股票进行投资，同时，本基金将根据宏观经济形势、政策环境变化、市场风格转换等，适时调整组合配置比例，以达到资产的保值增值。

业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：中债国债指数收益率×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股票型基金，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 | 李明 | 霍小武

联系电话 | 010-84183229 | 021-52629999-212056

电子邮件 | liuhao@zqjy.com.cn | 01059700@icloud.com

客户服务电话 | 400-818-8118 | 95561

传真 | 010-94183311 | 021-62155021

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互连网址 | www.guodu.com

基金年度报告备置地点 | 国都基金管理人及本基金托管人住所

5.3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

orderNumberOne 期间 | 2018年 | 2017年 | 2016年12月21日(基金首次生效日) | -2016年12月31日

本期末净资产 | -9,529,026.13 | 30,994,974.21 | 341,790.10

本期利润 | -9,084,872.96 | 30,490,243.94 | 343,358.10

加权平均基金份额本期利润 | -0.0229 | 0.0768 | 0.0009

本期基金份额净值增长率为-2.13% | 7.66% | 0.09%

orderNumberTwo 期间 | 2018年末 | 2017年末 | 2016年末

期末可供分配基金份额利润 | 0.0047 | 0.0766 | 0.0009

期末基金资产净值 | 418,824,201.04 | 427,900,073.00 | 397,561,533.24

期末基金份额净值 | 1.0647 | 1.0767 | 1.0000

注：1.本期已实现收益指本期利息收入、股息收入、其他收入和公允价值变动收益，其中利息收入和股息收入已扣除红利再投和转股的申购款部分；本期利润为本期已实现收益加上本期利润分配。

2.期初可供分配利润按计划分配比例计算的本期利润为正数，即期初可供分配利润的本期利润部分为正数，而期末可供分配利润的本期利润部分为负数，则期末可供分配利润的本期利润为期初可供分配利润（即期初部分相抵后未实现部分）为负数。

3. 所述基金业绩指标不包括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 基金份额净值

阶段 | 份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④

过去三个月 | -0.40% | 0.07% | -3.33% | 0.64% | 2.84% | -0.57%

过去六个月 | -0.41% | 0.09% | -3.89% | 0.59% | 3.46% | -0.50%

过去一年 | -2.13% | 0.15% | -7.24% | 0.53% | 5.11% | -0.38%

自基金合同生效起至今 | 5.47% | 0.18% | -1.13% | 0.41% | 6.60% | -0.23%

3.2.2 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

收益率变动的比较

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同生效以来未发生利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

5.4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

国都证券股份有限公司（以下简称“国都证券”）是经中国证监会批准设立的证券公司和北京国信国际信托有限公司证券业务务的主体，吸收其他股东于2001年12月28日成立的综合类证券公司，注册资本为人民币1亿元。2015年6月23日公司组织形式由有限责任公司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4600000000万元。2015年12月31日完成增资扩股，注册资本变更为3000000000万元。2018年1月9日，经中国证监会核准，公司获准开展公开募集基金业务资格，截至2018年12月31日，公司已6次开放定期开放式基金投资业务——国都聚鑫定期开放型混合型证券投资基金、国都聚鑫定期开放型混合型证券投资基金、国都消费升级灵活配置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助理简介

姓名 | 职称 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | 证券从业年限 | 说明

杨鹏飞 | 基金经理 | 2017年6月29日 | 7年 | 经济学硕士，曾任中航证券有限公司金融研究所研究员、高级研究员，中航证券有限公司金融研究所高级投资经理，现任职国都证券投资基金管理部总经理助理，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。

张威 | 基金经理 | 2016年12月21日 | 11年 | 硕士，历任国都证券研究所固定收益部助理、债券分析师、国都证券研究所固定收益部高级研究员，现任职国都证券投资基金管理部总经理助理，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。

4.2 管理人对报告期内内部控制制度执行情况的专项说明

本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构公平交易制度指引》等法律法规的规定和《国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金公平交易制度指引》等有关法律制度的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则和坦诚相待的态度，对相关信息披露、相关信息披露等方面，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的环境氛围。

4.3 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，本基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.4 普通投资者对基金投资决策的影响分析

2018年股票指数整体呈现下行趋势，虽然在年末有所反弹，全年无一行业取得正收益，反而股市普遍呈现下跌趋势，而在2017年股市大幅上涨之后的结构性分化下，央行流动性紧缩使得相对宽松，资金价格回落，无风险利率下行，债券收益率取得明显涨幅，但历史告诉我们，往往在极度宽松的环境下，流动性将向相对宽松的品种倾斜，从而导致收益率的分化。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.6 管理人对报告期内基金的经营情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.7 管理人对报告期内基金的财务状况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.8 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.9 管理人对报告期内基金的估值政策和程序的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.10 管理人对报告期内基金的会计政策的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.11 管理人对报告期内基金的托管情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.12 管理人对报告期内基金的风险评价

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.13 管理人对基金持续经营能力的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.14 管理人对基金未来发展的展望

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.15 管理人对基金持续经营能力的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.16 管理人对基金持续经营能力的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.17 管理人对基金持续经营能力的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.18 管理人对基金持续经营能力的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.19 管理人对基金持续经营能力的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.20 管理人对基金持续经营能力的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.21 管理人对基金持续经营能力的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.22 管理人对基金持续经营能力的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.23 管理人对基金持续经营能力的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.24 管理人对基金持续经营能力的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.25 管理人对基金持续经营能力的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.26 管理人对基金持续经营能力的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.27 管理人对基金持续经营能力的说明

本基金报告期内，基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，完善公平交易制度，通过公平交易和工具等方式在公平交易严格控制公平交易执行，公平对待各投资组合。

4.28 管理人对基金持续经营能力的说明