

# 益民多利债券型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：益民基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

本基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

本基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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及其更新。

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.....	7
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.....	12
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.....	12
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<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 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.....	39
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.5 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.....	40
7.6 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.....	41
7.7 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.....	41
7.8 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.....	41
7.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.10 投资组合报告附注.....	41
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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.....	43
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	47
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>49</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.....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	49

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>50</b>
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	益民多利债券型证券投资基金
基金简称	益民多利债券
基金主代码	560005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 5 月 21 日
基金管理人	益民基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	20,192,538.69 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是参与分享中国经济成长与资本的长期稳健增值，债券的利息收入与股票的红利收益及资本增值是本基金投资组合收益的主要来源。本基金通过组合投资，在保证资产安全和流动性的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	投资策略是实现投资目标的基本手段，本基金投资策略包括一级资产配置策略、债券投资策略、红利股选股策略以及新股申购策略。管理人通过深入分析宏观经济、政策、估值水平、资金供求以及股债吸引力等几个方面的运行趋势及对证券市场的作用机制，并且依据此结论制定相应的大类资产配置目标与策略轮动。债券方面本基金将在系统化定量分析技术和严格投资管理的基础上，采取收益率预期策略、收益率曲线策略、久期管理策略和类别配置策略等积极投资策略，把握市场创新机会，发现、确认并利用市场低效和市场转型进程中的价格失衡，实现组合增值。在股票组合层面，本基金主要采取定量与定性分析相结合的方法，结合全面的品质优选、深入细致的实地调研，力求在上市股票中精选出财务状况健康、业绩稳定增长、估值水平合理的优秀投资品种，提高组合的整体收益率水平。在新股申购上，本基金将研究股票首次发行 (IPO) 股票及增发新股的上市公司基本面因素，根据股票市场整体定价水平，估计新股上市交易的合理价格，同时参考一级市场资金供求关系，从而制定相应的新股申购策略。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×75%+沪深 300 指数收益率×20%+活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于债券型基金产品，在开放式基金中，风险和收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币基金和中短债基金，属于中低风险的产品。

### 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		益民基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘伟	张燕
	联系电话	010-63105556	0755-83199084
	电子邮箱	jianchabu@ymfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-650-8808	95555
传真		010-63100588	0755-83195201
注册地址		重庆市渝中区上清寺路 110 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区宣外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100052	518040
法定代表人		翁振杰	李建红

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ymfund.com
基金半年度报告备置地点	北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	益民基金管理有限公司	北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A

### § 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	-114,851.90
本期利润	22,333.85
加权平均基金份额本期利润	0.0011
本期加权平均净值利润率	0.13%
本期基金份额净值增长率	0.15%
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	-2,950,964.41
期末可供分配基金份额利润	-0.1461
期末基金资产净值	17,241,574.28
期末基金份额净值	0.8539
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	-4.04%

注：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。

本期已实现收益指基金本期利息收入、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收益。

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）。

#### 3.2 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

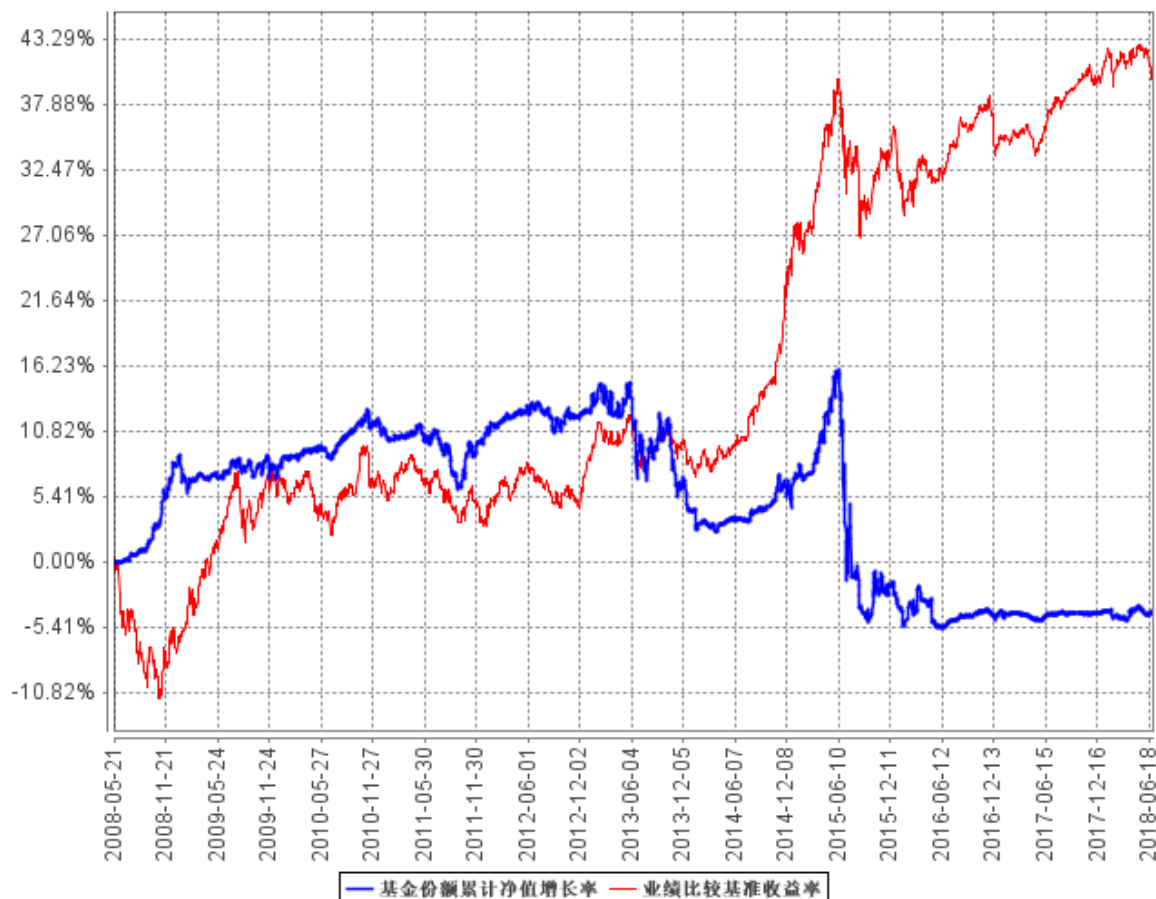
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.16%	0.05%	-1.06%	0.26%	1.22%	-0.21%
过去三个月	0.73%	0.09%	-0.42%	0.24%	1.15%	-0.15%
过去六个月	0.15%	0.09%	0.58%	0.23%	-0.43%	-0.14%
过去一年	0.39%	0.06%	2.45%	0.19%	-2.06%	-0.13%
过去三年	-11.18%	0.34%	4.02%	0.31%	-15.20%	0.03%
自基金合同生效起至今	-4.04%	0.30%	40.80%	0.35%	-44.84%	-0.05%



注：本着公允性原则、可复制性原则和再平衡等原则，本基金选取“75%×中证全债指数+20%×沪深 300 指数+5%×活期存款利率”作为本基金的比较基准。

### 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



注：1、本基金合同于 2008 年 5 月 21 日生效，2008 年 6 月 23 日开始办理申购、赎回业务。

2、根据益民多利债券型投资基金基金合同规定，本基金建仓期 6 个月结束时，各项资产投资组合比率均符合基金合同的约定。

### 3.3 其他指标

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

益民基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2005 年 12 月 12 日正式成立。公司股东由重庆国际信托股份有限公司（出资比例 49%）、中国新纪元有限公司（出资比例 31%）、中山证券有限责任公司（出资比例 20%）组成，注册资本为 1 亿元人民币，注册地：重庆，主要办公地点：北京。截至 2018 年 6 月 30 日，公司管理的基金共有十只，均为开放式基金。其中，益民货币市场基金于 2006 年 7 月 17 日成立，首发规模超过 17 亿份；益民红利成长混合型证券投资基金于 2006 年 11 月 21 日成立，首发规模近 9 亿份；益民创新优势混合型证券投资基金于 2007 年 7 月 11 日成立，首发规模近 73 亿份；益民多利债券型投资基金于 2008 年 5 月 21 日成立，首发规模超过 7 亿份；益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金于 2012 年 8 月 16 日成立，首发规模超过 11 亿份；益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金于 2013 年 12 月 13 日成立，首发规模超过 10 亿份；益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金于 2015 年 5 月 6 日成立，首发规模近 14 亿份；益民中证智能消费主题指数证券投资基金于 2017 年 5 月 8 日成立；益民信用增利纯债一年定期开放债券型证券投资基金于 2017 年 10 月 16 日成立，益民优势安享灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 4 月 23 日成立。

#### 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		
赵若琼	益民信用增利纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、益民中证智能消费主题指数证券投资基金基金经理、益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理、益民货币市	2018年2月6日	-	10	曾任民生证券研究院行业研究员，方正证券研究所行业研究员，2015年6月加入益民基金管理有限公司任研究部研究员。自2017年2月28日起任益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2017年5月8日起任益民中证智能消费主题指数证券投资基金基金经理，自2018年2月6日起任益民信用增利纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、益民货币

	市场基金基金经理、益民多利债券型基金基金经理				市场基金基金经理、益民多利债券型证券投资基金经理。
吴桢培	益民多利债券型基金基金经理、益民货币市场基金基金经理、益民信用增利纯债基金经理	2017年2月22日	2018年2月6日	7	曾任日信证券研究所行业研究员，东兴证券研究所行业研究员，2015年2月加入益民基金管理有限公司任研究部行业研究员。自2017年2月22日起任益民货币市场基金和益民多利债券型证券投资基金基金经理，自2017年10月16日起任益民信用增利纯债基金经理。

注：此处的“任职日期”为基金合同生效日或根据公司决定确定的聘任日期，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民多利债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

## 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，本基金管理人严格遵守了公平交易管理制度的规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，不存在直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

本报告期内，各投资组合1日、3日、5日同向交易价差大部分通过统计检验，不存在价差显著的情况。但因投资组合规模悬殊、投资组合经理对市场判断的差异及决策时机不同，导致投资组合间七组配对分析出现1日、3日、5日同向交易价差检验显著的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易及利益输送的异常交易行为，不同投资组合之间不存在交易所公开竞价同日反向交易，不存在报告期内所有投资组合参与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的 5% 的情形。

## 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

2018 年上半年，从央行连续 3 次降准到近期国常会的更积极财政政策连续发出宽松信号。政策边际放松、加上流动性充裕、经济数据表现平平、中美贸易战，使得上半年利率债表现较好：10Y 国债、10Y 国开收益率分别下降约 40BP、80BP 至 3.56%、4.18%，年内涨幅最大达到 17.7%、28.8%；得益于央行定向降准，R007 与 DR007 均值较 2017 年下半年分别下降了 17.91BP 和 6.44BP。由于金融监管的进一步趋紧、流动性持续宽松、超预期降准、银行表外业务压缩、资管新规落地、社融持续下降、信用违约频发等因素，今年上半年的信用债可以总结为观望、下行再分化的走势。全债、金融债、国债、转债、公司债指数分别上涨 5.18%、5.91%、5.00%、1.68%、2.63%。

报告期内本基金调整持仓结构向利率债集中，规避信用债的违约风险及流动性风险。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.8539 元，份额累计净值为 0.9749 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.15%，业绩比较基准收益率为 0.58%。

## 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，由于目前利率债收益率已处于去年 2、3 季度水平，目前没看到继续向下的突破点，且海外资金整体处于收缩的状态，上涨的美债收益率也制约着国内债券的下行空间。从政府态度能看出，资金面未来整体不太会有又掉头变紧。信用债方面，虽然近期央行发布的资管新规通知有助于缓解银行表外资产的回表压力，但不会推翻整体缩紧的融资环境。本基金未来的配置计划仍然以中期利率债为主，适当参与高评级短久期信用债及城投债。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述：

根据相关规定，本基金管理人成立估值委员会，估值委员会是基金估值的最高决策机构，负责公司估值相关决策及执行。成员由公司总经理、投资总监、基金运营部、产品开发部、监察稽核部、基金会计等相关人员组成。相关参与人员应当具有上市公司研究和估值、基金投资等方面较丰富的经验，熟悉相关法规和估值方法。

研究部行业研究员：研究部负责人及行业研究员负责长期停牌股票等没有市价的投资品种所

属行业的专业研究，参与基金组合停牌股票行业属性和重估方法的确定，并在估值讨论中承担确定参考行业指数的职责；相关参与人员应当具有多年的行业研究经验，能够较好的对行业发展趋势做出判断，熟悉相关法规和估值方法。

**监察稽核部：**监察稽核部参与估值流程的人员，应当对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等相关事项的合法合规性进行审核和监督，发现问题及时要求整改；参与估值流程的人员必须具有一定的会计核算估值知识和经验，应当具备熟知与估值政策相关的各项法律法规、估值原则和方法的专业能力，并有从事会计、核算、估值等方面业务的经验和工作经历。

**产品开发部产品开发人员：**产品开发人员负责估值相关数值的处理和计算，并参与公司对基金的估值方法的确定。该成员应当在基金的风险控制与绩效评估工作方面具有较为丰富的经验，具备基金绩效评估专业能力，并熟悉相关法规和估值方法。

**基金运营部基金会计：**基金会计在估值流程中的相关工作职责是按照基金会计核算准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金拥有的各类有价证券、其他资产和负债进行核算，进而确定基金资产的公允价值。参与基金长期停牌股票估值方法的确定，复核由估值委员会提供的估值价格，并与相关托管行进行核对确认。如有不符合的情况出现，立即向估值委员会反映情况，并提出合理的调整建议。基金会计人员应当与估值相关的外部机构保持良好的沟通，获悉的与基金估值相关的重大信息及时向公司及估值小组反馈。基金会计应当具备多年基金从业经验，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，具备熟悉及了解基金估值法规、政策和方法的专业能力。

#### 2、基金经理参与或决定估值的程度：

基金管理公司估值委员会成员中不包括基金经理。基金经理不参与估值工作决策和执行的过程。

#### 3、本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

#### 4、本公司现没有进行任何定价服务的签约。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

#### 1、基金收益分配原则：

(1) 基金收益分配比例按有关规定制定；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 在符合有关基金分红条件的情况下，本基金收益分配每年不超过十二次，基金合同生效

不满三个月，收益可不分配，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 90%；

- (4) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- (5) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- (6) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- (7) 每一基金份额享有同等分配权；
- (8) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

2、本报告期内，本基金利润分配情况：

本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### **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**

本报告期内，本基金有连续二十个工作日出现基金份额持有人数不满二百人和基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、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：益民多利债券型证券投资基金

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	3,984,994.08	1,299,293.04
结算备付金		1,577.08	-
存出保证金		586.77	1,000.93
交易性金融资产	6.4.7.2	13,983,149.60	16,684,780.90
其中：股票投资		-	5,556.00
基金投资		-	-
债券投资		13,983,149.60	16,679,224.90
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	165,420.34	390,255.22
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		18,135,727.87	18,375,330.09
<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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,901.34	10,353.12
应付托管费		2,828.95	2,958.03
应付销售服务费		4,243.41	4,437.08
应付交易费用	6.4.7.7	1,288.59	-
应交税费		837,138.52	837,041.90



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	38,752.78	139,000.00
负债合计		894,153.59	993,790.13
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	20,192,538.69	20,387,144.74
未分配利润	6.4.7.10	-2,950,964.41	-3,005,604.78
所有者权益合计		17,241,574.28	17,381,539.96
负债和所有者权益总计		18,135,727.87	18,375,330.09

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8539 元，基金份额总额 20,192,538.69 份。

## 6.2 利润表

会计主体：益民多利债券型证券投资基金

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 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		178,779.84	171,365.46
1.利息收入		277,140.21	191,323.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	9,854.56	9,470.75
债券利息收入		258,750.68	174,296.90
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,534.97	7,555.89
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-236,691.48	-6,839.83
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-232,962.00	-16,625.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-3,729.48	9,515.94
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	-	269.99
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	137,185.75	-13,124.61
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	1,145.36	6.36
<b>减：二、费用</b>		156,445.99	200,479.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	60,111.12	61,675.50

2. 托管费	6.4.10.2.2	17,174.48	17,621.60
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	25,761.84	26,432.32
4. 交易费用	6.4.7.19	4,107.32	8,539.84
5. 利息支出		-	1,939.58
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,939.58
6. 税金及附加		138.90	-
7. 其他费用	6.4.7.20	49,152.33	84,270.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		22,333.85	-29,114.14
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		22,333.85	-29,114.14

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：益民多利债券型证券投资基金

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）	20,387,144.74	-3,005,604.78	17,381,539.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,333.85	22,333.85
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）	-194,606.05	32,306.52	-162,299.53
其中：1.基金申购款	2,725,167.64	-397,696.69	2,327,470.95
2.基金赎回款	-2,919,773.69	430,003.21	-2,489,770.48
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）	20,192,538.69	-2,950,964.41	17,241,574.28

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 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)	21,087,296.86	-3,122,391.56	17,964,905.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-29,114.14	-29,114.14
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)	-433,258.73	65,125.17	-368,133.56
其中：1.基金申购款	79,117.46	-11,794.62	67,322.84
2.基金赎回款	-512,376.19	76,919.79	-435,456.40
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)	20,654,038.13	-3,086,380.53	17,567,657.60

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：

_____	_____	_____
黄桦	慕娟	慕娟
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

益民多利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2008]354号文《关于同意益民多利债券型证券投资基金募集的批复》的批准，由益民基金管理有限公司于2008年4月8日至2008年5月16日向社会公开募集，基金合同于2008年5月21日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次募集规模为745,713,266.60份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为益民基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金投资于在交易所和银行间市场交易的债券、短期金融工具，可转换债券，沪、深交易

所上市的股票和权证，现金以及根据中国证监会相关规定允许投资的其他金融产品。本基金的股票投资以绩优股为主，并且参与新股申购。若因新股中签导致股票投资比例超过 20%，本基金将在 10 个工作日内进行调整。本基金可投资于权证，其投资比例不超过基金资产的 3%。本基金投资组合的资产配置比例为：债券等固定收益类产品不低于基金资产的 80%，其他证券资产不高于基金资产的 20%，其中，现金或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率×75%+沪深 300 指数收益率×20%+活期存款利率×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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 2 号《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 年上半年度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 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金

融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资和债券投资等；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 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

本基金本报告期无会计政策变更事项。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更事项。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期不存在重大会计差错更正事项。

### 6.4.6 税项

#### 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017] 90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 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	3,984,994.08
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：	3,984,994.08

### 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	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	13,931,880.70	13,983,149.60
	银行间市场	-	-
	合计	13,931,880.70	13,983,149.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	13,931,880.70	13,983,149.60	51,268.90

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 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	797.97
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	0.70
应收债券利息	164,621.37
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-



应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.30
合计	165,420.34

#### 6.4.7.6 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	1,136.09
银行间市场应付交易费用	152.50
合计	1,288.59

#### 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	38,752.78
合计	38,752.78

#### 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	20,387,144.74	20,387,144.74
本期申购	2,725,167.64	2,725,167.64
本期赎回(以“-”号填列)	-2,919,773.69	-2,919,773.69
- 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	20,192,538.69	20,192,538.69

**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	-2,668,101.45	-337,503.33	-3,005,604.78
本期利润	-114,851.90	137,185.75	22,333.85
本期基金份额交易产生的变动数	25,008.62	7,297.90	32,306.52
其中：基金申购款	-354,295.12	-43,401.57	-397,696.69
基金赎回款	379,303.74	50,699.47	430,003.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,757,944.73	-193,019.68	-2,950,964.41

**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	9,387.75
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	462.33
其他	4.48
合计	9,854.56

**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	1,219,916.00
减：卖出股票成本总额	1,452,878.00
买卖股票差价收入	-232,962.00

### 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	-3,729.48
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	-3,729.48

#### 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	15,852,867.51
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	15,423,112.75
减：应收利息总额	433,484.24
买卖债券差价收入	-3,729.48

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末持有资产支持证券。

#### 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

本基金本报告期末持有贵金属。

#### 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

本基金本报告期末持有衍生工具。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期末持有衍生工具。

**6.4.7.16 股利收益****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	137,185.75
——股票投资	444.00
——债券投资	136,741.75
——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：应税金融资产公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	137,185.75

**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	1,142.93
转换费收入	2.43
合计	1,145.36

**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	3,954.82
银行间市场交易费用	152.50
合计	4,107.32

**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	14,876.39
信息披露费	14,876.39
银行间帐户维护费	18,000.00
银行费用	1,399.55
合计	49,152.33

## 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

本基金本报告期不存在应披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金管理人经与益民多利债券型证券投资基金的基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，决定以现场开会方式召开本基金的基金份额持有人大会讨论终止基金合同事宜。

本基金管理人于 2018 年 6 月 25 日收到中国证监会核准，允许本基金管理人以现场开会方式召开益民多利债券型基金基金份额持有人大会讨论终止基金合同事宜。本基金于 2018 年 7 月 26 日以现场开会方式在北京召开基金份额持有人大会，会议审议并表决通过了《关于终止益民多利债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。根据基金份额持有人大会通过的议案及方案说明，本基金于 2018 年 8 月 10 日起进入基金财产清算程序。

## 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

本报告期内无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 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.9.2.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.9.2.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.9.2.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.9.2.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元位进行权证交易。

#### 6.4.9.2.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 6.4.9.3 关联方报酬

#### 6.4.9.3.1 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1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	60,111.12	61,675.50
其中：支付销售机构的客户维护费	1,308.72	1,702.43

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计算，计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月前三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，支付日期顺延。

#### 6.4.9.3.2 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1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	17,174.48	17,621.60

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计算，计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月底，按月支付。经基金管理人和基金托管人双方核对后，

由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 6.4.9.3.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费
益民基金管理有限公司	23,386.68
招商银行股份有限公司	997.37
中山证券有限责任公司	1.81
合计	24,385.86
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费
益民基金管理有限公司	23,346.71
招商银行股份有限公司	1,391.98
中山证券有限责任公司	1.81
合计	24,740.50

注：销售服务费是指基金管理人根据基金合同的约定及届时有效的相关法律法规的规定，从基金财产中计提的一定比例的费用，用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

基金销售服务费按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年费率计算，计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费由基金管理人每日计算，每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起 3 个工作日内向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于当日从基金财产中一次性支付给基金销售机构。

#### 6.4.9.4 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金管理人本报告期及上年度可比期间均未持有本基金份额。

**6.4.9.5.2 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**

截止本报告期末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

**6.4.9.6 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1月1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
招商银行	3,984,994.08	9,387.75	3,386,036.61	9,158.80

**6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.10 利润分配情况**

本基金本报告期末未进行利润分配。

**6.4.11 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

**6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

**6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

**6.4.12 金融工具风险及管理****6.4.12.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设合规审查与风险控制委员



会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理主要由各部门协作完成风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

#### 6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和部分定期存款存放在本基金的托管行；其他定期存款存放在资信状况良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	284,028.40	10,022,948.20
合计	284,028.40	10,022,948.20

注：表中列示的未评级债券投资为国家债券。

##### 6.4.12.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	499,750.00	1,552,915.00
AAA 以下	0.00	252,631.00
未评级	13,199,371.20	4,850,730.70
合计	13,699,121.20	6,656,276.70

表中列示的未评级债券投资为国家债券及国家政策性金融债。

#### 6.4.12.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金报告期末未持有资产支持证券。

#### 6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），均能够及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的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% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)，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%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在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时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### 6.4.12.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.12.4.1.1 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	3,984,994.08	-	-	-	-	-	3,984,994.08
结算备付金	1,577.08	-	-	-	-	-	1,577.08
存出保证金	586.77	-	-	-	-	-	586.77
交易性金融资产	499,750.00	284,028.40	10,220,691.60	2,978,679.60	-	-	13,983,149.60
应收利息	-	-	-	-	-	165,420.34	165,420.34
资产总计	4,486,907.93	284,028.40	10,220,691.60	2,978,679.60	-	165,420.34	18,135,727.87
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,901.34	9,901.34
应付托管费	-	-	-	-	-	2,828.95	2,828.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,243.41	4,243.41
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,288.59	1,288.59
应交税费	-	-	-	-	-	837,138.52	837,138.52
其他负债	-	-	-	-	-	38,752.78	38,752.78
负债总计	-	-	-	-	-	894,153.59	894,153.59
利率敏感度缺口	4,486,907.93	284,028.40	10,220,691.60	2,978,679.60	-	-728,733.25	17,241,574.28
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	1,299,293.04	-	-	-	-	-	1,299,293.04
存出保证金	1,000.93	-	-	-	-	-	1,000.93
交易性金融资产	2,026,391.90	10,022,948.20	-	-4,629,884.80	-	5,556.00	16,684,780.90
应收利息	-	-	-	-	-	390,255.22	390,255.22
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,326,685.87	10,022,948.20	-	-4,629,884.80	-	395,811.22	18,375,330.09
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,353.12	10,353.12
应付托管费	-	-	-	-	-	2,958.03	2,958.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,437.08	4,437.08
应交税费	-	-	-	-	-	837,041.90	837,041.90
其他负债	-	-	-	-	-	139,000.00	139,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	993,790.13	993,790.13
利率敏感度缺口	3,326,685.87	10,022,948.20	-	-4,629,884.80	-	-597,978.91	17,381,539.96

注：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。

#### 6.4.12.4.1.2 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）
	利率上升 25 个基点	-41,015.75	-38,195.28
	利率下降 25 个基点	41,326.74	38,617.77

#### 6.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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。

#### 6.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，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。本基金主要投资于固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.12.4.3.1 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	-	-	5,556.00	0.03
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	13,983,149.60	81.10	16,679,224.90	95.96
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	13,983,149.60	81.10	16,684,780.90	95.99
----	---------------	-------	---------------	-------

#### 6.4.12.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值分析法管理市场风险。

#### 6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层次的余额为人民币 13,983,149.6 元，无属于第一、第三层次的余额。

##### (2) 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和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

于本报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元的情况。本基金于 2018 年 7 月 26 日以现场开会方式在北京召开基金份额持有人大会，会议审议并表决通过了《关于终止益民多利债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。根据基金份额持有人大会通过的议案及方案说明，本基金于 2018 年 8 月 10 日起进入基金财产清算程序。

## § 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,983,149.60	77.10
	其中：债券	13,983,149.60	77.10
	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	3,986,571.16	21.98
8	其他各项资产	166,007.11	0.92
9	合计	18,135,727.87	100.00

### 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

本基金本报告期末未持有境内股票投资组合。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

### 7.3 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	601939	建设银行	724,934.00	4.17
2	601398	工商银行	379,512.00	2.18
3	600028	中国石化	342,432.00	1.97

注：“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。

### 7.3.1 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	601939	建设银行	550,436.00	3.17
2	600028	中国石化	379,494.00	2.18
3	601398	工商银行	284,634.00	1.64
4	601211	国泰君安	5,352.00	0.03

注：“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。

### 7.3.2 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	1,446,878.00
卖出股票收入（成交）总额	1,219,916.00

### 7.4 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	3,262,708.00	18.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,220,691.60	59.28
	其中：政策性金融债	10,220,691.60	59.28
4	企业债券	499,750.00	2.90
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	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,983,149.60	81.10

### 7.5 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	101,820	10,220,691.60	59.28



2	010107	21 国债(7)	25,740	2,630,628.00	15.26
3	122366	14 武钢债	5,000	499,750.00	2.90
4	010303	03 国债(3)	3,510	348,051.60	2.02
5	019571	17 国债 17	2,840	284,028.40	1.65

## 7.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.10 投资组合报告附注

### 7.10.1

本基金本报告期末有前十名证券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、处罚的情况。

### 7.10.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

### 7.10.3 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	586.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	165,420.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	166,007.11

**7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

**7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.10.6 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
139	145,270.06	18,388,256.77	91.06%	1,804,281.92	8.94%

### 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	1,681.05	0.0083%

### 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（2008年5月21日）基金份额总额	745,713,266.60
本报告期期初基金份额总额	20,387,144.74
本报告期基金总申购份额	2,725,167.64
减：本报告期基金总赎回份额	2,919,773.69
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	20,192,538.69

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有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

本报告期内，基金管理人、托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所未发生变化。

### 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

本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
安信证券	1	2,666,794.00	100.00%	2,483.52	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
安信证券	14,396,287.97	100.00%	50,500,000.00	100.00%	-	-

注：1、本公司租用券商交易单元的选择标准：

(1) 基本情况：包括但不限于资本充足，财务状况及最近三年盈利情况良好；经营行为规范，最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机构的处罚；主要股东实力强大；具备投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合进行证券交易的需要，并能为投资组合提供全面的信息服务；

(2) 公司治理：公司治理完善，股东会、董事会、监事会及管理层权责明确，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足投资组合运作高度保密的要求；

(3) 研究实力：有固定的研究机构和数量足够的专职研究人员以及研究水平处于行业领先水平的研究员；研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各项领域，并能在符合相关法规及执业规范的前提下，根据公司的特定要求，提供专题研究报告；研究报告应分析严谨，观点独立、客观，并具备较强的风险意识和风险测算能力；

(4) 服务能力：具备较强的服务意识，能主动为公司投资组合提供及时的市场信息及各种路演、公司联合调研、券商会议的信息和参加机会；或者具备某一区域的调研服务能力的优势；

(5) 综合业务能力：在投资银行业务上有较强的实力，能协助本公司投资组合参与股票、债券的发行；在新产品开发方面经验丰富，能帮助公司拓展资产管理业务（如 QDII、专户等集合理财产品）；在证券创新品种开发方面处于行业前列（如交易所固定收益平台、融资融券、金融期货等）；

(6) 其他因素（在某一具体方面的特别优势）。

2、本公司租用券商交易单元的程序：

(1) 基金的交易单元选择，投资总监、产品部、主动管理事业部、中央交易室经集体讨论后遵照上述标准填写《券商选择标准评分表》，并据此提出拟选券商名单以及相应的席位租用安排。挑选时应考虑在深沪两个市场都租用足够多的席位以保障交易安全。必要时可要求券商提供相应证明文件；

(2) 投资总监向投资决策委员会上报拟选券商名单、相应的席位租用安排以及相关评选材料；

(3) 投资决策委员会审查拟选券商名单及相应的席位租用安排，审查通过后由总经理上报董事会，董事会如对公司管理层有相应授权的，由公司管理层依据授权内容办理；

(4) 券商名单及相应的席位租用安排确定后，中央交易室参照公司《证券交易单元租用协议》及《综合服务协议》范本负责协调办理正式协议签署等相关事宜。若实际签署协议与协议范本不一致的，由中央交易室将实际签署协议提交监察稽核部进行合规性审核。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	益民多利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要	《上海证券报》及公司网站	2018 年 1 月 4 日
2	益民多利债券型证券投资基金更新招募说明书	《上海证券报》及公司网站	2018 年 1 月 4 日
3	益民多利债券型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	《上海证券报》及公司网站	2018 年 1 月 19 日
4	关于旗下基金参加大泰金石基金销售有限公司基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》及公司网站	2018 年 2 月 1 日
5	关于旗下基金参加北京展恒基金销售股份有限公司基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》及公司网站	2018 年 2 月 1 日
6	关于旗下基金开通上海利得基金销售有限公司定投、转换业务的公告	《上海证券报》及公司网站	2018 年 2 月 5 日
7	益民基金管理有限公司关于变更益民多利债券型证券投资基金基金经理的公告	《上海证券报》及公司网站	2018 年 2 月 7 日
8	益民多利债券型证券投资基金 2017 年度报告摘要	《上海证券报》及公司网站	2018 年 3 月 29 日
9	益民多利债券型证券投资基金 2017 年度报告	《上海证券报》及公司网站	2018 年 3 月 29 日
10	关于益民基金管理有限公司旗下部分基金调整赎回费率的公告	《上海证券报》及公司网站	2018 年 3 月 30 日
11	关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	《上海证券报》及公司网站	2018 年 3 月 31 日
12	关于旗下基金参加东海证券股份有限公司基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》及公司网站	2018 年 4 月 2 日
13	益民多利债券型证券投资基金	《上海证券报》及公	2018 年 4 月 20 日

	2018 年第 1 季度报告	司网站	
14	关于以现场开会方式召开益民多利债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	《上海证券报》及公司网站	2018 年 6 月 26 日
15	关于以现场开会方式召开益民多利债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	《上海证券报》及公司网站	2018 年 6 月 27 日
16	关于以现场开会方式召开益民多利债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	《上海证券报》及公司网站	2018 年 6 月 28 日



## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018.1.1-2018.6.30	18,387,669.71	-	-	18,387,669.71	91.06%
产品特有风险							
<p>1、利率风险</p> <p>利率风险主要是指由宏观经济形势、货币财政政策以及债券市场资金供求关系的变化所带来的市场利率水平的波动，并因此产生的投资风险。利率与债券市场价格呈负相关关系。当利率上升时，债券的市场价格下降，从而造成本基金持有未到期短期债券的资本损失，并进一步影响基金份额的收益。利率的波动可能导致债券基金跌破基金份额净值面值。当利率发生波动时，中短期债券基金的净值波动一般会高于货币市场基金。</p> <p>2、信用风险</p> <p>信用风险是指由于债券发行人或者交易对手的信用出现不同程度的问题而导致基金资产遭受的损失。具体而言，本基金的信用风险主要包括以下几个方面：（1）债券发行人出现违约、无法支付到期本息引起的损失；（2）债券发行人信用评级等级下降导致的个券价格下降引起的损失；（3）交易对手出现违约或者违规投资操作而引起的损失。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立益民多利债券型证券投资基金的文件；
- 2、益民多利债券型证券投资基金基金合同；
- 3、益民多利债券型证券投资基金托管协议；
- 4、中国证监会批准设立益民基金管理有限公司的文件；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的公告。

### 12.2 存放地点

北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A。

### 12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人益民基金管理有限公司。

咨询电话：(86) 010-63105559 4006508808

公司传真：(86) 010-63100608

公司网址：<http://www.ymfund.com>

益民基金管理有限公司

2018 年 8 月 28 日