

**国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金**  
**2018 年第 4 季度报告**  
**2018 年 12 月 31 日**

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年一月十九日

## §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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2019 年 1 月 16 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。

依据《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》、《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自 2018 年 10 月 17 日起至 2018 年 11 月 19 日 17:00 止。会议审议事项为《关于国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型相关事项的议案》。2018 年 11 月 20 日，在本基金的基金托管人宁波银行股份有限公司授权代表的监督下，本基金管理人对本次大会表决进行了计票，上海市通力律师事务所对计票过程进行了见证，上海市东方公证处对计票过程及结果进行了公证。本次基金份额持有人大会权益登记日登记在册的本基金基金份额持有人及代理人可参加本次持有人大会并参与表决。经统计，参加本次基金份额持有人大会投票表决的本基金基金份额持有人及代理人所持基金份额小于本基金权益登记日基金总份额的二分之一，未达到《基金合同》约定的关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的有效条件。

根据《基金法》的有关规定和《基金合同》的有关约定，基金管理人将在规定时间内就本次大会审议的议案重新召集基金份额持有人大会。具体可查阅本基金管理人于 2018 年 11 月 21 日披露的《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	国泰宁益定期开放灵活配置混合
基金主代码	003760
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 8 月 1 日
报告期末基金份额总额	59,285,752.83 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求稳健的投资回报。
投资策略	<p>(一) 封闭期投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，综合评价各类资产的风险收益水平，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金主要根据上市公司获利能力、成长能力以及估值水平来进行个股选择。运用定性和定量相结合的方法，综合分析其投资价值和成长能力，确定投资标的股票，构建投资组合。</p> <p>3、固定收益类投资工具投资策略</p> <p>本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券等固定收益类金融工具，投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。</p>

	<p>4、中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金在严格控制风险的前提下，综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特征，选择具有相对优势的品种，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>6、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，尽力减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。</p> <p>7、股指期货投资策略</p> <p>本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、合约选择，谨慎地进行投资，旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国泰宁益定期开放灵活配置混合 A	国泰宁益定期开放灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	003760	003761
报告期末下属分级基金的份额总额	54,992,736.59 份	4,293,016.24 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2018 年 10 月 1 日-2018 年 12 月 31 日)	
	国泰宁益定期开放灵活配置混合 A	国泰宁益定期开放灵活配置混合 C
1.本期已实现收益	214,746.92	15,819.36
2.本期利润	-3,821,556.14	-298,856.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0695	-0.0696
4.期末基金资产净值	45,538,091.46	3,549,635.33
5.期末基金份额净值	0.8281	0.8268

注：（1）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；

（2）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 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

###### 1、国泰宁益定期开放灵活配置混合 A：

阶段	净值增长率 ①	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	①—③	②—④
----	------------	---------------	----------------	----------------	-----	-----

				准差④		
过去三个月	-7.74%	1.03%	-5.31%	0.81%	-2.43%	0.22%

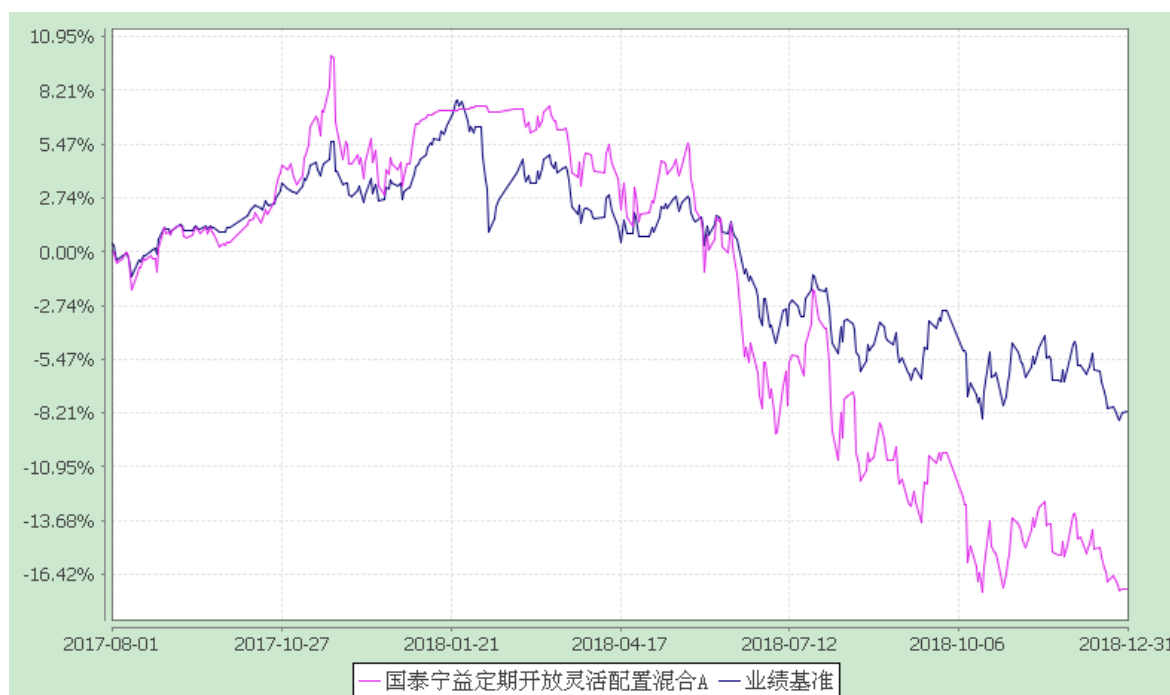
**2、国泰宁益定期开放灵活配置混合 C:**

阶段	净值增长率 ①	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
过去三个月	-7.77%	1.03%	-5.31%	0.81%	-2.46%	0.22%

**3.2.2 自基金合同生效以来基金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**

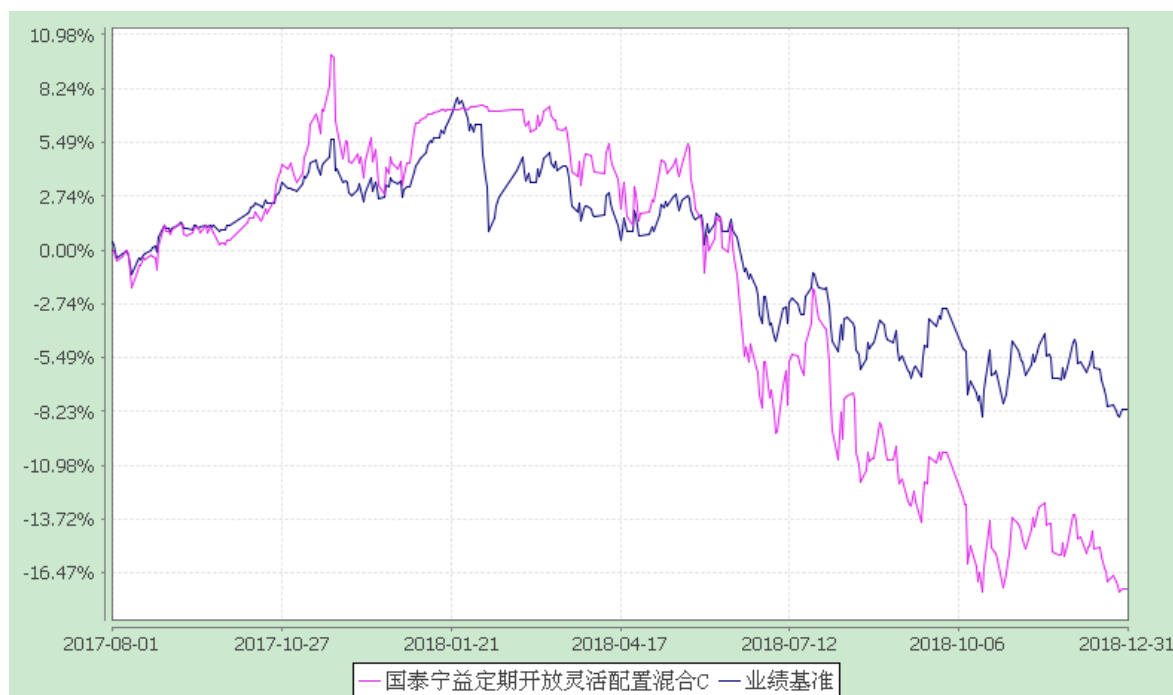
国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2017 年 8 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日)

**1. 国泰宁益定期开放灵活配置混合 A:**



注：本基金的合同生效日为 2017 年 8 月 1 日，本基金在 6 个月建仓结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

**2. 国泰宁益定期开放灵活配置混合 C:**



注：本基金的合同生效日为 2017 年 8 月 1 日，本基金在 6 个月建仓结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
艾小军	本基金的基金经理、国泰黄金 ETF、国泰上证 180 金融 ETF、国泰上证	2017-08-09	-	17 年	硕士。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006 年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金管理有限公司，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、上证 180 金融交易型开放式指数证券

	<p>180 金融 ETF 联接、国泰深证 TMT50 指数分级、国泰沪深 300 指数、国泰黄金 ETF 联接、国泰中证军工 ETF、国泰中证全指证券公司 ETF、国泰策略价值灵活配置混合、国泰量化策略收益混合、国泰国证航天军工指数（LOF）、国泰中证申万证券行业指数（LOF）、国泰量化成长优选混合、</p>			<p>投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2015 年 3 月起兼任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 4 月起兼任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月起兼任国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理，2016 年 7 月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2017 年 5 月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 12 月任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 4 月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 5 月起兼任国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2017 年 5 月至 2018 年 7 月任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月起兼任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月起兼任国泰量化成长优选混合型证券投资基金和国泰量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 8 月起兼任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 12 月起兼任国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来）的基金经理。2017 年 7 月起任投资总监（量化）</p>
--	--	--	--	--



	国泰量化价值精选混合、国泰结构转型灵活配置混合的基金经理、投资总监（量化）、金融工程总监				、金融工程总监。
梁杏	本基金的基金经理、国泰国证医药卫生行业指数分级、国泰国证食品饮料行业指数分级、国泰量化收益灵活配置混合的基金经理、量化投资（事业）部总监	2018-01-26	-	11 年	学士。2007 年 7 月至 2011 年 6 月在华安基金管理有限公司担任高级区域经理。2011 年 7 月加入国泰基金管理有限公司，历任产品品牌经理、研究员、基金经理助理。2016 年 6 月起任国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金和国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月起兼任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 7 月起兼任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月至 2018 年 7 月任量化投资（事业）部副总监，2018 年 7 月起任量化投资（事业）部总监。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实守信、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度受中美贸易摩擦持续升级、国内经济下行压力加大、股票质押爆仓风险频出等利空因素持续打压，A股市场以10月8日大跌3.72%开盘，持续下跌，并击穿2638前期低点，创出了2449的新低，后在高层稳定民企的讲话以及一系列化解股权质押风险的政策支持下，市场迎来了一波小幅反弹。随后在华为高层被捕，市场风险偏好降低。此外，医药带量采购对医药板块形成持续打压。多重因素影响，A股重回跌势，期间上证综指下跌11.6%，主要指数中，上证50下跌12%，中证100指数下跌12.5%，沪深300指数下跌12.5%，中证500指数下跌13.2%，中证1000指数下跌11.2%，中小板指下跌18.2%，创业板指下跌11.4%。

在行业表现上，申万一级行业中表现较好的农林牧渔、综合和通信，分别下跌0.07%、3.69%和

4.01%，表现较差的为钢铁、采掘、医药生物，分别下跌了 18.97%、18.03%、17.99%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰宁益定期开放灵活配置混合 A 在 2018 年第四季度的净值增长率为-7.74%，同期业绩比较基准收益率为-5.31%。

国泰宁益定期开放灵活配置混合 C 在 2018 年第四季度的净值增长率为-7.77%，同期业绩比较基准收益率为-5.31%。

#### 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 2019 年，我们认为经济面临较大下滑压力、中美贸易谈判这两大因素将是影响 A 股全年的主线。在经济面临较大下滑压力的情况下，稳增长、稳就业的政策出台的时机和力度将相当程度上影响 A 股走势，我们预计 A 股仍将以震荡为主。行业板块上，以基本面持续改善的军工、2019 年将迎来牌照发放的 5G 以及安全自主可控等领域或将迎来较好的投资机会。就一季度而言，包括地方债提前发行、增值税减税出台、中美贸易 90 天谈判成果等因素都将影响市场走势。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 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	28,524,811.80	57.88
	其中：股票	28,524,811.80	57.88
2	固定收益投资	41,989.50	0.09
	其中：债券	41,989.50	0.09
	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	16,000,000.00	32.47
	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	4,624,205.21	9.38
7	其他各项资产	91,342.96	0.19
8	合计	49,282,349.47	100.00

## 5.2 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	322,872.00	0.66
B	采矿业	1,094,008.00	2.23
C	制造业	15,124,697.50	30.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	316,962.00	0.65
E	建筑业	663,096.00	1.35
F	批发和零售业	209,034.00	0.43
G	交通运输、仓储和邮政业	487,892.00	0.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,450,464.40	2.95
J	金融业	4,963,686.60	10.11
K	房地产业	1,477,435.00	3.01
L	租赁和商务服务业	261,517.80	0.53
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	2,153,146.50	4.39
S	综合	-	-
	合计	28,524,811.80	58.11

**5.3 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	300144	宋城演艺	68,900	1,471,015.00	3.00
2	000895	双汇发展	55,600	1,311,604.00	2.67
3	000338	潍柴动力	141,200	1,087,240.00	2.21
4	000002	万科 A	44,500	1,059,990.00	2.16
5	600038	中直股份	25,000	934,000.00	1.90
6	600760	中航沈飞	30,000	831,300.00	1.69
7	600309	万华化学	27,900	780,921.00	1.59
8	002410	广联达	37,100	772,051.00	1.57
9	601009	南京银行	108,900	703,494.00	1.43
10	600216	浙江医药	75,738	657,405.84	1.34

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	41,989.50	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	41,989.50	0.09

**5.5 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**

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113020	桐昆转债	350	34,989.50	0.07

2	110049	海尔转债	70	7,000.00	0.01
---	--------	------	----	----------	------

## 5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 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。

## 5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、合约选择，谨慎地进行投资，旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“南京银行”公告其镇江分行违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

根据 2018 年 1 月 30 日南京银行发布的相关公告，南京银行镇江分行收到中国银行业监督管理委员会江苏监管局行政处罚决定书（苏银监罚决字【2018】1 号），对镇江分行违规办理票据业务违反审慎经营原则的行为罚款 3230 万元人民币。

该情况发生后，本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

5.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	48,815.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	42,527.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	91,342.96

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰宁益定期开放灵活配置混合A	国泰宁益定期开放灵活配置混合C
本报告期初基金份额总额	54,992,736.59	4,293,016.24
报告期基金总申购份额	-	-
减：报告期基金总赎回份额	-	-

报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	54,992,736.59	4,293,016.24

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	国泰宁益定期开放灵活配置混合A	国泰宁益定期开放灵活配置混合C
报告期期初管理人持有的基金份额	52,699,000.00	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的基金份额	52,699,000.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	88.89	-

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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年10月1日至2018年12月31日	52,699,000.00	-	-	52,699,000.00	88.89%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

依据《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》、《国



泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自 2018 年 10 月 17 日起至 2018 年 11 月 19 日 17:00 止。会议审议事项为《关于国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型相关事项的议案》。2018 年 11 月 20 日，在本基金的基金托管人宁波银行股份有限公司授权代表的监督下，本基金管理人对本次大会表决进行了计票，上海市通力律师事务所对计票过程进行了见证，上海市东方公证处对计票过程及结果进行了公证。本次基金份额持有人大会权益登记日登记在册的本基金基金份额持有人及代理人可参加本次持有人大会并参与表决。经统计，参加本次基金份额持有人大会投票表决的本基金基金份额持有人及代理人所持基金份额小于本基金权益登记日基金总份额的二分之一，未达到《基金合同》约定的关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的有效条件。

根据《基金法》的有关规定和《基金合同》的有关约定，基金管理人将在规定时间内就本次大会审议的议案重新召集基金份额持有人大会。具体可查阅本基金管理人于 2018 年 11 月 21 日披露的《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复
- 2、国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 3、国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

### 9.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

### 9.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇一九年一月十九日