

国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：国都证券股份有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由拟任董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 23 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，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 7 月 3 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 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
§5 托管人报告	15
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	58

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	58
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	58
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
8.12 投资组合报告附注	59
§9 基金份额持有人信息	61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
9.3 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	61
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	61
§10 开放式基金份额变动	63
§11 重大事件揭示	64
11.1 基金份额持有人大会决议	64
11.2 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	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11.8 其他重大事件	66
§12 影响投资者决策的其他重要信息	67
12.1 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	67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§13 备查文件目录	68
13.1 备查文件目录	68
13.2 存放地点	68
13.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	国都消费升级
场内简称	—
基金主代码	004777
前端交易代码	—
后端交易代码	—
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 7 月 3 日
基金管理人	国都证券股份有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	22,837,968.49 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	—
上市日期	—

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以基本面为立足点，精选消费升级中具有持续增长潜力的上市公司，以分享中国经济增长与结构转型带来的投资机会。通过积极主动的投资管理，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中证内地消费主题指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国都证券股份有限公司	兴业银行股份有限公司

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	中准会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市海淀区首体南路 22 号楼 4 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、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

3.1.1 期间数据和指标	2017 年 7 月 3 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日	2016 年	2015 年
本期已实现收益	1,681,817.83	-	-
本期利润	2,109,929.05	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0531	-	-
本期加权平均净值利润率	5.17%	-	-
本期基金份额净值增长率	4.11%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	938,061.96	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.0411	-	-
期末基金资产净值	23,776,030.45	-	-
期末基金份额净值	1.0411	-	-
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	4.11%	-	-

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

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

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

4. 本基金基金合同于 2017 年 7 月 3 日生效，截止报告期末未满一年。

3.2 基金净值表现

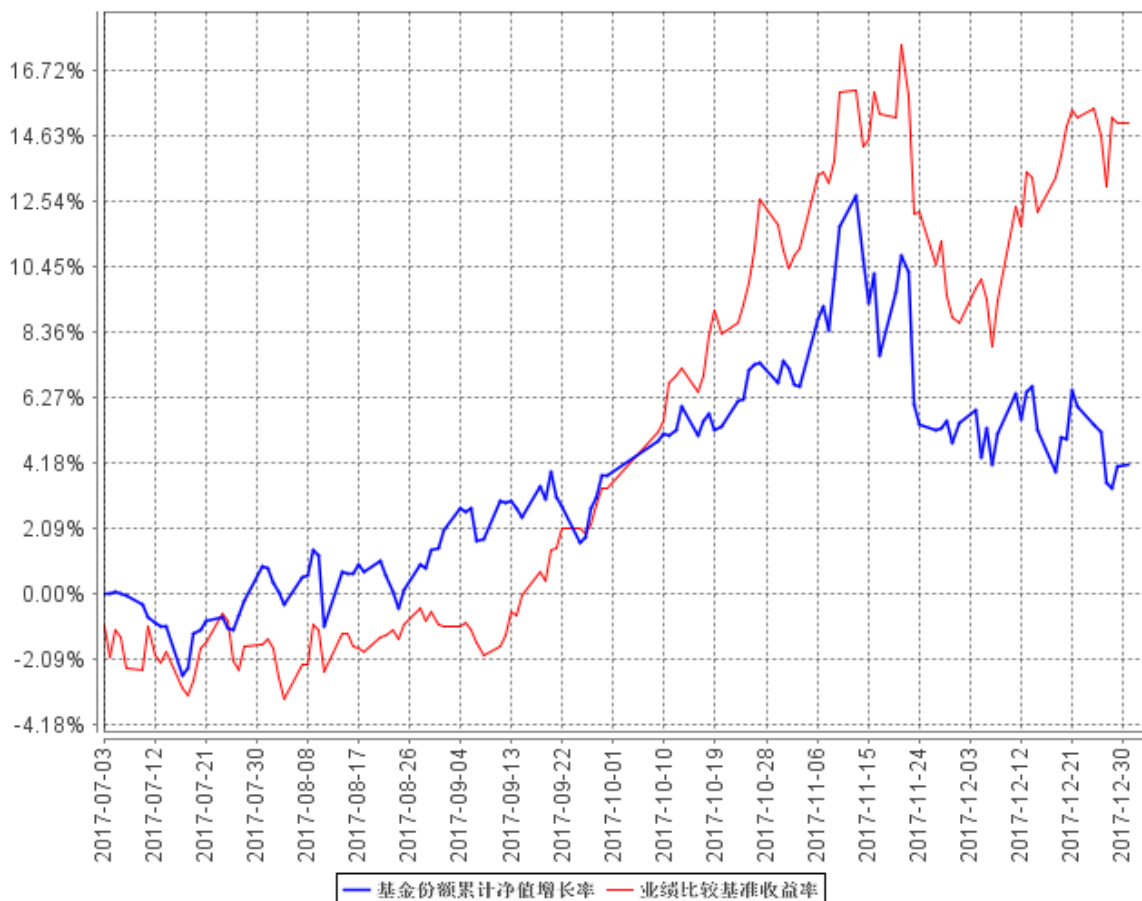
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.31%	1.04%	11.27%	1.09%	-10.96%	-0.05%
自基金合同	4.11%	0.85%	15.02%	0.88%	-10.91%	-0.03%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

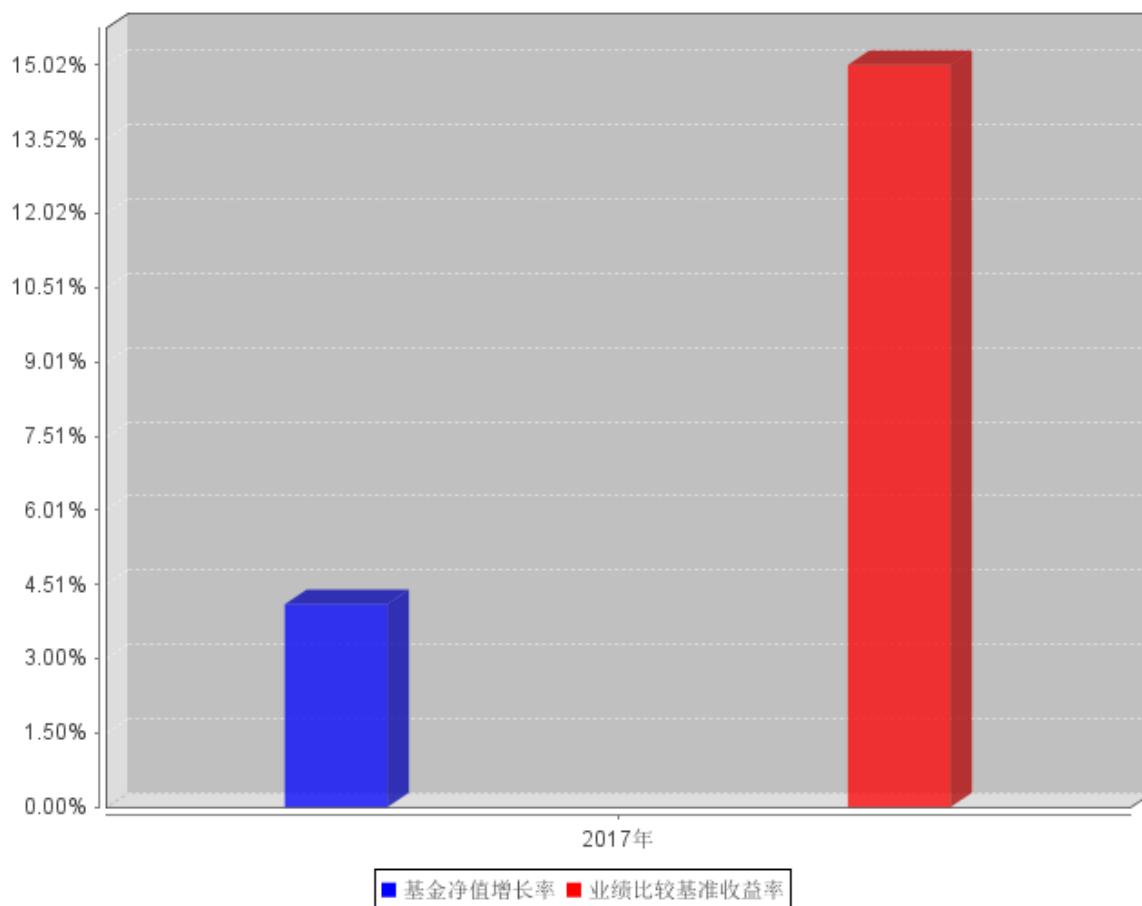
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 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

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对比图



3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同自 2017 年 7 月 3 日起生效，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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2016 年末，公司净资产 86.47 亿元。2014 年 8 月 19 日，经中国证监会批准，公司获准开展公募基金管理业务资格，截至 2017 年 12 月 31 日，本公司管理 6 只开放式证券投资基金——国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金、国都聚益定期开放混合型证券投资基金、国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金、国都智能制造混合型发起式证券投资基金、国都量化精选混合型证券投资基金。

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		
尹德才	基金经理	2017 年 7 月 3 日	—	6 年	硕士，2011 年加入天相投资顾问有限公司证券部研究员，2013 年加入国都证券任研究所化工行业研究员、基金管理部高级行业研究员、基金经理助理，现任国都证券基金管理部基金经理。
张小强	基金经理	2017 年 7 月 3 日	—	7 年	硕士，曾任中国畜牧兽医学会信息与市场研究部分析师，天相投资顾问有限公司分析师，国都证券研究所分析师，负责农业、食品等消费品行业研究。现任国都

					证券投资基金管理部基金经理。
--	--	--	--	--	----------------

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《国都证券股份有限公司公募证券投资基金业务公平交易管理办法》。通过制定科学合理的投资决策体系、交易执行规范及对公平交易的监控与报告、相关信息披露等手段，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年市场在结构性行情中度过，一边是供给侧改革、行业集中度提升、白酒家电类蓝筹业绩高增速推动下波澜壮阔的蓝筹行情，一边是大量的中小盘个股股价持续下行，分化异常明显。

在这种行情的背后一方面是蓝筹类公司业绩的推动，一方面是金融去杠杆背景下风险偏好的下移，业绩增速与估值匹配成为各机构投资者投资的基本准绳，机构抱团取暖趋势明显。本基金产品 2017 年 7 月 3 日成立，本着稳健投资、绝对收益的理念，在白酒家电类估值持续走高逐步进入合理区间的时期选择谨慎建仓，在各投资机构抱团取暖的方向上选择了中性均衡的仓位配置，主要的配置分布在食品饮料、家电、消费电子、医药、通信等行业，全年虽然取得了绝对收益，但在白酒家电方向上仓位的谨慎配置使得本产品净值增长与业绩比较基准产生了较大的差距。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2017 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.0411 元，份额累计净值 1.0411 元，年度基金份额净值增长率 4.11%，同期基金业绩比较基准 15.02%，本基金份额增长率低于业绩比较基准 10.91 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年。中国总体债务规模仍然在增加，且 2017 年居民杠杆增速较快，去杠杆、金融强监管的政策在 2018 仍然延续，防范金融风险仍然是政府工作的重点之一。海外方面，全球量化宽松退出，美联储加息节奏趋紧，美国贸易保护主义抬头。从两个层面来分析，一是金融强监管和去杠杆的大背景下风险偏好继续受到压制，二是出口方面对经济的拉动大概率要弱于 2017 年。从二级市场表现的角度来看，2017 年蓝筹类业绩增速在 2018 年继续超越的概率偏小，估值的角度看也进入合理区间，但部分行业方向在经过年初的调整之后具备了长期投资的价值。同时，中小创中部分行业和优秀个股在经过长时间的非理性调整之后已经具备投资价值。结合两个方向，2018 年投资中防范系统性风险和重点行业均衡配置是基本原则。投资的方向上看好如下几个行业，家电行业中的空调和厨电、医疗和大病种制药、消费电子、通信、国产汽车、民用航空、社会服务等。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规。公司高度重视基金的合规运作和风险管理，从合法合规保障基金份额持有人利益出发，不断完善内部控制制度和业务流程，强化执行力度，推动了各项内控机制的完善和落实。

公司将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

本报告期内，公司的监察稽核工作重点如下：

(1) 加强制度建设，构建全面、严谨的内部控制体系。公司根据法律法规等规范性文件，制定了较为完善的相关管理制度。同时，根据业务发展对原有制度进行及时更新。

(2) 全面加强风险监控，不断提高风险管理水平。公司加强事前、事中、事后风险控制有效结合，通过多种形式提高内控管理质量、优化风险管理水平。本报告期内，公司各项业务未发生重大风险事件。

(3) 有计划地开展监察稽核工作，确保工作的深入性和有效性。本报告期内，公司通过日常监察与内部审计的方式，不断提高和完善监察稽核工作的深度和广度，提高业务部门人员的风险意识水平。

(4) 加强合规审核工作。本报告期内，内控部门审核了公司制定（修订）的制度、公募基金产品的宣传文件、与代销机构合作的相关协议、相关信息披露文件及投资运作相关事项；另外，合规部门协助处理参与新股申购网下询价的关联关系核查。

(5) 强化合规教育和培训。公司及时传达与基金业务相关的法律法规，开展多种形式的合规培训，不断提升员工的合规守法意识。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金出现基金资产净值低于五千万元的情况。但是本基金为发起式基金，截至报告期末本基金基金合同生效未满三年，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定，基金管理人不对本基金持有人数及基金资产净值进行监控。

根据本基金基金合同相关规定，基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值规模低于 2 亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	中准审字[2018]1040 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金全体持有人
审计意见	我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的财务报表编制基础的有关规定编制，公允反映了该基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 7 月 3 日（合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日的经营成果和所有者权益（净值）变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金的管理人国都证券股份有限公司（以下简称管理人），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>管理人对其他信息负责，其他信息包括该基金 2017 年度管理报告、但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金的管理人负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理人负责评估该基金的持续经营能力，披露</p>

	与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非管理人计划清算该基金、终止运营或别无其他现实的选择。管理人负责监督该基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。	
会计师事务所的名称	中准会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	田雍	王健
会计师事务所的地址	北京市海淀区首体南路 22 号楼 4 层	
审计报告日期	2018 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	1,429,841.45	-
结算备付金		428,144.26	-
存出保证金		51,182.09	-
交易性金融资产	7.4.7.2	17,654,771.80	-
其中：股票投资		17,654,771.80	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,458,033.64	-
应收利息	7.4.7.5	-62.67	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		24,021,910.57	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
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		32,719.47	-
应付托管费		3,271.94	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	94,888.71	-
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	115,000.00	-
负债合计		245,880.12	-
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	22,837,968.49	-
未分配利润	7.4.7.10	938,061.96	-
所有者权益合计		23,776,030.45	-
负债和所有者权益总计		24,021,910.57	-

注：1、报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0411 元，基金份额总额 22,837,968.49 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2017 年 7 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 7 月 3 日(基 金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		3,051,639.73	-
1. 利息收入		192,144.57	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	96,028.14	-
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		96,116.43	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,289,385.94	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,226,089.07	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	63,296.87	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	428,111.22	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	141,998.00	-
减：二、费用		941,710.68	-
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	300,184.01	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	30,018.37	-
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	496,428.30	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	115,080.00	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,109,929.05	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,109,929.05	-

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 7 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 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）	63,791,190.90	-	63,791,190.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,109,929.05	2,109,929.05
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）	-40,953,222.41	-1,171,867.09	-42,125,089.50
其中：1. 基金申购款	242,324.35	16,100.94	258,425.29
2. 基金赎回款	-41,195,546.76	-1,187,968.03	-42,383,514.79
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）	22,837,968.49	938,061.96	23,776,030.45

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

常喆

李蔚

封欣

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2017 年 5 月 24 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》证监许可〔2017〕776 号文核准注册，自 2017 年 6 月 12 日至 2017 年 6 月 23 日公开募集设立。本基金为混合型发起式证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 63,783,200.81 元人民币，其中管理人运用固有资金认购 10,001,000.00 份基金份额，并经中准会计师事务所（特殊普通合伙）“中准验字[2017]第 1073 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金合同》于 2017 年 7 月 3

日正式生效。

基金合同生效日的基金份额总额为 63,791,190.90 份基金单位，其中认购资金利息折合 7,990.09 份基金单位。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券（包括可分离交易可转债）、可交换债券）、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 7 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

—

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2017 年 7 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的予以终止确认:①收取该金融资产现金流量的合同权利终止;②该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;③该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

（1）证券交易所上市的有价证券的估值

a. 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

b. 交易所上市交易或挂牌转让的不含权和含权固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价；

c. 交易所上市的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

d. 交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

a. 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

b. 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

c. 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（3）全国银行间债券市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价。

（4）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(5) 股指期货合约以估值当日结算价进行估值, 估值当日无结算价的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化的, 采用最近交易日结算价估值。

(6) 如有充足理由认为按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的方法估值。

(7) 存在相关法律法规以及监管部门有相关规范且适用于本基金的, 从其规定。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金①具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的; 且②交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益; 于处置时, 其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益, 其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算, 实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算, 实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定, 按实际支出金额, 列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的, 则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则:

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下, 本基金每年收益分配次数最多为 6 次, 每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%, 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(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) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值, 即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4) 每一基金份额享有同等分配权;

(5) 在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下, 基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式, 不需召开基金份额持有人大会审议;

(6) 法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分: (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用; (2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果, 以决定向其配置资源、评价其业绩; (3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征, 并且满足一定条件的, 则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作, 不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 于 2017 年 12 月 28 日前对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 28 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除第三方估值机构根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,本基金自2017年12月28日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除第三方估值机构根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

因本基金尚未投资流通受限股票,该会计估计变更目前对本基金产品损益影响为0。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税(2017)56号《财政部 税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 增值税

根据财税(2017)56号,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,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(2) 企业所得税

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

(3) 个人所得税

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

(4) 印花税

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	1,429,841.45	-
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	1,429,841.45	-

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度末数据。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	17,226,660.58	17,654,771.80	428,111.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	17,226,660.58	17,654,771.80	428,111.22
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 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	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	-	-	-

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度末数据。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,214.35	-
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	211.97	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-2,514.29	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	25.30	-
合计	-62.67	-

注：1、“其他”为应收结算保证金利息。

2、本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度末数据。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	94,888.71	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	94,888.71	-

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度末数据。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	115,000.00	-
合计	115,000.00	-

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度末数据。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	63,791,190.90	63,791,190.90
本期申购	242,324.35	242,324.35
本期赎回（以“-”号填列）	-41,195,546.76	-41,195,546.76
- 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	22,837,968.49	22,837,968.49

注：1、本期申购份额含红利再投、转换入份额，本期赎回份额含转换出份额。

2、本基金自 2017 年 6 月 12 日 2017 年 6 月 23 日期间公开发售，共募集有效净认购资金

63,783,200.81 元，其中管理人运用自有资金认购 10,001,000.00 元。根据《国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入为 7,990.09 元在本基金成立后，折算为 7,990.09 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3、根据《国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》和《国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2017 年 7 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 8 月 6 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购和赎回业务自 2017 年 8 月 7 日起开始办理。

7.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,681,817.83	428,111.22	2,109,929.05
本期基金份额交易产生的变动数	-216,816.97	-955,050.12	-1,171,867.09
其中：基金申购款	9,190.63	6,910.31	16,100.94
基金赎回款	-226,007.60	-961,960.43	-1,187,968.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,465,000.86	-526,938.90	938,061.96

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	89,708.46	-
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	6,101.99	-
其他	217.69	-
合计	96,028.14	-

注：1、“其他”为结算保证金利息收入。

2、本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 3 日(基金合 同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	160,473,710.96	-
减：卖出股票成本总额	158,247,621.89	-
买卖股票差价收入	2,226,089.07	-

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期末进行贵金属投资。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金在本报告期无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	63,296.87	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	63,296.87	-

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	428,111.22	-
——股票投资	428,111.22	-
——债券投资	-	-
——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	-	-
合计	428,111.22	-

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	141,998.00	-
合计	141,998.00	-

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	496,428.30	-
银行间市场交易费用	-	-
合计	496,428.30	-

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	15,000.00	-
信息披露费	100,000.00	-
银行划款手续费	80.00	-
合计	115,080.00	-

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.21 分部报告

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

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金未发生需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期的关联方交易主要包括通过关联方交易单元进行的交易、关联方报酬、基金管理人运用固有资金投资本基金等情况。

本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
国都证券股 份有限公司	335,947,993.43	100.00%	-	-

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行涉及支付关联方费用的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
国都证券股份 有限公司	667,500,000.00	100.00%	-	-

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年7月3日(基金合同生效日)至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国都证券股份 有限公司	309,487.62	100.00%	94,888.71	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例

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

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

3、本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 3 日(基金合同生效 日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付 的管理费	300,184.01	-
其中：支付销售机构的客 户维护费	57,659.05	-

注：1、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：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

3、本基金合同生效日为 2017 年 07 月 03 日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 3 日(基金合同生效 日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	30,018.37	-

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2017 年 7 月 3 日）持有的基金份额	10,001,000.00	-
期初持有的基金份额	10,001,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,001,000.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	43.7911%	-

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金其他关联方在本报告期末未持有本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	1,429,841.45	89,708.46	-	-

注：1、本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按约定利率计息。

2、本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在承销期内未参与关联方承销证券交易。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

7.4.12 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601600	中国铝业	2017 年 9 月 12 日	重大资产重组	6.64	2018 年 2 月 26 日	7.28	60,000	458,400.00	398,400.00	-
600309	万华化学	2017 年 12 月 5 日	重大资产重组	37.94	-	-	8,000	306,455.00	303,520.00	-

注：本基金截至 2017 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人根据发展战略、经营目标及资本实力制定风险管理政策，确定风险偏好、风险

容忍度、风险限额等指标，在确保整体风险可承受的前提下，积极、恰当地管理风险，实现经风险调整后的收益最大化。

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

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

监事会负责监督董事会和经营管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。

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

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

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

公司全体工作人员在执业行为中履行各自的风险管理责任。

7.4.13.2 信用风险

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金组合资产以现金、股票、债券、7 日内到期的国债逆回购等高流动性资产为主，停牌股票等主动投资于流动性受限资产占基金资产净值比例未超过 15%，7 个工作日可变现资产市值占基金净值的比例维持在 90%以上，可流通股票资产变现天数低于 1 天，除管理人固有资金持有份额外，单一投资者持有基金份额最高比例不超过 20%。

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

7.4.13.4 市场风险

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

1、政策风险

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

2、经济周期风险

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

3、购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

4、上市公司经营风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	1,429,841.45	-	-	-	-	-	1,429,841.45
结算备付金	428,144.26	-	-	-	-	-	428,144.26
存出保证金	51,182.09	-	-	-	-	-	51,182.09
交易性金融资产	-	-	-	-	-	17,654,771.80	17,654,771.80
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,458,033.64	4,458,033.64
应收利息	-	-	-	-	-	-62.67	-62.67
资产总计	1,909,167.80	-	-	-	-	22,112,742.77	24,021,910.57
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	32,719.47	32,719.47
应付托管费	-	-	-	-	-	3,271.94	3,271.94
应付交易费用	-	-	-	-	-	94,888.71	94,888.71
其他负债	-	-	-	-	-	115,000.00	115,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	245,880.12	245,880.12
利率敏感度缺口	1,909,167.80	-	-	-	-	21,866,862.65	23,776,030.45
上年度末 2016 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							
负债							

注：1、上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

2、本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度末数据。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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	17,654,771.80	74.25	—	—
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	17,654,771.80	74.25	—	—

注：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 3 日，无上年度末数据。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动		
	Beta 系数以市场过去一年的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足一年的股票，默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 12 月 31 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数下跌 5%	-967,705.93	—

	沪深 300 指数上涨 5%	967, 705. 93	
--	----------------	--------------	--

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

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

本期末本基金风险价值为 628, 139. 91 元，占基金资产净值比例为 2. 69%。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 16, 952, 851. 80 元，属于第二层次的余额为 701, 920. 00 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	17,654,771.80	73.49
	其中：股票	17,654,771.80	73.49
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	1,857,985.71	7.73
8	其他各项资产	4,509,153.06	18.77
9	合计	24,021,910.57	100.00

注：由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	12,225,270.00	51.42
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	1,545,311.80	6.50
G	交通运输、仓储和邮政业	999,250.00	4.20
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	580,400.00	2.44
K	房地产业	949,080.00	3.99

L	租赁和商务服务业	1,170,660.00	4.92
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	184,800.00	0.78
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	17,654,771.80	74.25

注：以上行业分类以 2017 年 12 月 31 日的证监会行业分类标准为依据。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000725	京东方 A	120,000	694,800.00	2.92
2	603883	老百姓	10,000	629,900.00	2.65
3	603708	家家悦	30,590	612,411.80	2.58
4	601888	中国国旅	14,000	607,460.00	2.55
5	600029	南方航空	50,000	596,000.00	2.51
6	600036	招商银行	20,000	580,400.00	2.44
7	002027	分众传媒	40,000	563,200.00	2.37
8	601233	桐昆股份	25,000	562,250.00	2.36
9	600745	闻泰科技	16,000	539,680.00	2.27
10	600667	太极实业	60,000	537,600.00	2.26
11	600887	伊利股份	16,000	515,040.00	2.17
12	002049	紫光国芯	10,000	479,900.00	2.02
13	000513	丽珠集团	7,000	465,150.00	1.96
14	600809	山西汾酒	8,000	455,920.00	1.92
15	000786	北新建材	20,000	450,000.00	1.89
16	002293	罗莱生活	30,000	444,000.00	1.87
17	300373	扬杰科技	14,000	419,580.00	1.76
18	002327	富安娜	40,000	418,000.00	1.76
19	000002	万科 A	13,000	403,780.00	1.70
20	601600	中国铝业	60,000	398,400.00	1.68

21	000663	永安林业	20,000	359,600.00	1.51
22	000636	风华高科	30,000	356,400.00	1.50
23	600516	方大炭素	12,000	346,560.00	1.46
24	000063	中兴通讯	9,000	327,240.00	1.38
25	601155	新城控股	11,000	322,300.00	1.36
26	002415	海康威视	8,000	312,000.00	1.31
27	002597	金禾实业	12,000	311,040.00	1.31
28	002311	海大集团	13,000	304,200.00	1.28
29	600309	万华化学	8,000	303,520.00	1.28
30	601933	永辉超市	30,000	303,000.00	1.27
31	600352	浙江龙盛	25,000	292,750.00	1.23
32	601100	恒立液压	10,000	274,400.00	1.15
33	002042	华孚色纺	20,000	267,800.00	1.13
34	600196	复星医药	6,000	267,000.00	1.12
35	002365	永安药业	8,000	264,720.00	1.11
36	000703	恒逸石化	12,000	258,840.00	1.09
37	002245	澳洋顺昌	25,000	256,250.00	1.08
38	600062	华润双鹤	10,000	247,500.00	1.04
39	600426	华鲁恒升	15,000	238,800.00	1.00
40	002285	世联行	20,000	223,000.00	0.94
41	002281	光迅科技	7,000	205,800.00	0.87
42	600703	三安光电	8,000	203,120.00	0.85
43	600487	亨通光电	5,000	202,100.00	0.85
44	002583	海能达	10,000	185,100.00	0.78
45	300015	爱尔眼科	6,000	184,800.00	0.78
46	002371	北方华创	4,000	165,760.00	0.70
47	002035	华帝股份	5,000	150,700.00	0.63
48	600004	白云机场	10,000	147,000.00	0.62

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600029	南方航空	2,588,222.00	10.89
2	000063	中兴通讯	2,238,865.00	9.42

3	002583	海能达	2,015,027.00	8.48
4	300433	蓝思科技	1,940,116.00	8.16
5	000998	隆平高科	1,863,330.00	7.84
6	600745	闻泰科技	1,841,827.00	7.75
7	002285	世联行	1,821,488.00	7.66
8	601233	桐昆股份	1,800,919.00	7.57
9	000636	风华高科	1,657,192.00	6.97
10	000725	京东方 A	1,623,000.00	6.83
11	601628	中国人寿	1,615,529.00	6.79
12	300015	爱尔眼科	1,588,913.00	6.68
13	002027	分众传媒	1,588,790.00	6.68
14	600584	长电科技	1,510,500.00	6.35
15	002092	中泰化学	1,503,614.00	6.32
16	300054	鼎龙股份	1,501,703.00	6.32
17	600703	三安光电	1,487,290.00	6.26
18	002745	木林森	1,452,436.00	6.11
19	601933	永辉超市	1,444,150.00	6.07
20	000786	北新建材	1,416,185.00	5.96
21	002222	福晶科技	1,403,297.00	5.90
22	000807	云铝股份	1,398,041.00	5.88
23	300136	信维通信	1,384,933.00	5.82
24	600667	太极实业	1,355,933.00	5.70
25	000418	小天鹅 A	1,342,826.00	5.65
26	002273	水晶光电	1,333,602.00	5.61
27	600809	山西汾酒	1,308,600.00	5.50
28	600887	伊利股份	1,261,490.00	5.31
29	600062	华润双鹤	1,255,916.00	5.28
30	600196	复星医药	1,255,887.00	5.28
31	600498	烽火通信	1,249,724.00	5.26
32	300133	华策影视	1,245,800.00	5.24
33	603708	家家悦	1,236,966.90	5.20
34	002049	紫光国芯	1,221,274.72	5.14
35	601888	中国国旅	1,190,912.00	5.01
36	000703	恒逸石化	1,168,690.00	4.92
37	002217	合力泰	1,141,170.00	4.80
38	002415	海康威视	1,135,150.50	4.77

39	603626	科森科技	1,125,630.00	4.73
40	000933	神火股份	1,108,510.00	4.66
41	000858	五 粮 液	1,099,163.34	4.62
42	603883	老百姓	1,081,789.00	4.55
43	002050	三花智控	1,070,307.00	4.50
44	000663	永安林业	1,069,958.00	4.50
45	002008	大族激光	1,051,236.00	4.42
46	002153	石基信息	1,049,206.00	4.41
47	600522	中天科技	1,048,624.00	4.41
48	002009	天奇股份	1,045,145.00	4.40
49	600702	沱牌舍得	1,042,236.00	4.38
50	002156	通富微电	1,037,422.00	4.36
51	002371	北方华创	1,033,184.00	4.35
52	601231	环旭电子	1,029,488.00	4.33
53	002449	国星光电	1,022,242.00	4.30
54	000830	鲁西化工	1,011,703.00	4.26
55	300036	超图软件	1,011,693.00	4.26
56	600426	华鲁恒升	984,448.00	4.14
57	002094	青岛金王	973,080.00	4.09
58	000002	万 科 A	969,150.00	4.08
59	601211	国泰君安	961,927.00	4.05
60	000970	中科三环	943,884.00	3.97
61	600004	白云机场	931,143.00	3.92
62	002643	万润股份	876,453.50	3.69
63	300373	扬杰科技	857,447.00	3.61
64	002736	国信证券	854,960.00	3.60
65	601601	中国太保	854,688.00	3.59
66	600309	万华化学	850,590.00	3.58
67	600779	水井坊	846,788.00	3.56
68	601100	恒立液压	841,552.00	3.54
69	000997	新 大 陆	836,905.00	3.52
70	601111	中国国航	835,219.00	3.51
71	002434	万里扬	820,000.00	3.45
72	002035	华帝股份	800,639.00	3.37
73	600596	新安股份	798,200.00	3.36
74	601600	中国铝业	796,800.00	3.35

75	600161	天坛生物	790,240.00	3.32
76	300327	中颖电子	788,798.00	3.32
77	601688	华泰证券	774,400.00	3.26
78	000513	丽珠集团	773,520.00	3.25
79	002007	华兰生物	772,780.00	3.25
80	002245	澳洋顺昌	758,338.00	3.19
81	601318	中国平安	751,700.00	3.16
82	300101	振芯科技	750,219.00	3.16
83	600171	上海贝岭	741,151.00	3.12
84	000776	广发证券	737,346.00	3.10
85	002572	索菲亚	727,683.00	3.06
86	002268	卫 士 通	723,530.40	3.04
87	300408	三环集团	715,900.00	3.01
88	002383	合众思壮	714,327.00	3.00
89	600999	招商证券	697,615.00	2.93
90	601377	兴业证券	695,200.00	2.92
91	300224	正海磁材	694,158.00	2.92
92	002463	沪电股份	682,291.77	2.87
93	000596	古井贡酒	665,008.00	2.80
94	601155	新城控股	662,476.00	2.79
95	002365	永安药业	651,388.00	2.74
96	002482	广田集团	651,200.00	2.74
97	002456	欧菲光	649,770.00	2.73
98	002680	长生生物	649,637.00	2.73
99	002019	亿帆医药	648,648.00	2.73
100	603868	飞科电器	642,680.00	2.70
101	002429	兆驰股份	635,926.00	2.67
102	601668	中国建筑	633,300.00	2.66
103	600297	广汇汽车	633,000.00	2.66
104	002294	信立泰	629,190.00	2.65
105	002281	光迅科技	627,692.00	2.64
106	600406	国电南瑞	627,143.00	2.64
107	002271	东方雨虹	619,044.00	2.60
108	600389	江山股份	616,583.00	2.59
109	600713	南京医药	613,098.00	2.58
110	601800	中国交建	611,750.00	2.57

111	000796	凯撒旅游	609,000.00	2.56
112	600460	士兰微	608,246.00	2.56
113	002251	步步高	607,120.00	2.55
114	603558	健盛集团	603,540.00	2.54
115	603198	迎驾贡酒	601,527.00	2.53
116	600804	鹏博士	601,078.00	2.53
117	002043	兔宝宝	600,850.00	2.53
118	600352	浙江龙盛	597,350.00	2.51
119	300418	昆仑万维	594,250.00	2.50
120	002727	一心堂	590,710.00	2.48
121	002326	永太科技	589,795.00	2.48
122	600036	招商银行	588,248.00	2.47
123	300228	富瑞特装	583,966.00	2.46
124	600270	外运发展	580,924.00	2.44
125	002410	广联达	578,777.00	2.43
126	000708	大冶特钢	578,400.00	2.43
127	603188	亚邦股份	566,659.14	2.38
128	600987	航民股份	564,100.00	2.37
129	300207	欣旺达	560,200.00	2.36
130	300206	理邦仪器	554,600.00	2.33
131	600216	浙江医药	551,590.00	2.32
132	002468	申通快递	540,000.00	2.27
133	600889	南京化纤	537,983.00	2.26
134	600729	重庆百货	536,600.00	2.26
135	000501	鄂武商A	524,976.00	2.21
136	002589	瑞康医药	523,435.00	2.20
137	000681	视觉中国	521,330.00	2.19
138	002407	多氟多	519,707.00	2.19
139	000166	申万宏源	519,600.00	2.19
140	000949	新乡化纤	519,000.00	2.18
141	002120	韵达股份	517,900.00	2.18
142	300075	数字政通	517,704.96	2.18
143	002773	康弘药业	513,021.00	2.16
144	600963	岳阳林纸	503,600.00	2.12
145	600340	华夏幸福	501,756.00	2.11
146	002664	信质电机	499,660.00	2.10

147	002079	苏州固锝	492,960.00	2.07
148	002146	荣盛发展	486,000.00	2.04
149	600271	航天信息	484,300.00	2.04
150	600233	圆通速递	484,212.00	2.04

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000063	中兴通讯	2,104,096.80	8.85
2	600029	南方航空	2,052,452.00	8.63
3	300433	蓝思科技	1,986,162.00	8.35
4	002583	海能达	1,920,420.00	8.08
5	000998	隆平高科	1,826,440.53	7.68
6	002285	世联行	1,677,672.00	7.06
7	601628	中国人寿	1,614,281.00	6.79
8	600584	长电科技	1,548,171.00	6.51
9	300136	信维通信	1,519,681.00	6.39
10	300054	鼎龙股份	1,505,390.00	6.33
11	002092	中泰化学	1,504,578.10	6.33
12	600745	闻泰科技	1,488,504.00	6.26
13	002745	木林森	1,478,731.25	6.22
14	300015	爱尔眼科	1,476,804.98	6.21
15	000807	云铝股份	1,464,234.00	6.16
16	002273	水晶光电	1,406,170.00	5.91
17	002222	福晶科技	1,376,654.00	5.79
18	601933	永辉超市	1,354,991.00	5.70
19	600703	三安光电	1,341,668.00	5.64
20	600702	沱牌舍得	1,303,206.00	5.48
21	600498	烽火通信	1,290,453.00	5.43
22	000418	小天鹅A	1,290,181.00	5.43
23	300133	华策影视	1,263,983.00	5.32
24	000636	风华高科	1,242,152.00	5.22
25	601233	桐昆股份	1,201,242.00	5.05
26	000858	五粮液	1,183,380.00	4.98

27	000725	京东方 A	1,165,190.00	4.90
28	600809	山西汾酒	1,122,520.00	4.72
29	000933	神火股份	1,118,884.07	4.71
30	603626	科森科技	1,113,140.60	4.68
31	002027	分众传媒	1,108,762.00	4.66
32	002008	大族激光	1,102,397.00	4.64
33	002449	国星光电	1,097,564.00	4.62
34	000830	鲁西化工	1,064,389.00	4.48
35	002156	通富微电	1,050,854.00	4.42
36	002050	三花智控	1,036,143.32	4.36
37	600522	中天科技	1,028,300.00	4.32
38	002217	合力泰	1,024,166.00	4.31
39	600196	复星医药	1,009,141.00	4.24
40	000970	中科三环	1,008,487.00	4.24
41	600062	华润双鹤	1,005,482.00	4.23
42	002009	天奇股份	1,000,245.00	4.21
43	002153	石基信息	989,054.00	4.16
44	000786	北新建材	984,540.00	4.14
45	300036	超图软件	983,761.00	4.14
46	601231	环旭电子	968,680.00	4.07
47	002371	北方华创	962,653.00	4.05
48	000703	恒逸石化	944,714.00	3.97
49	601601	中国太保	931,419.64	3.92
50	002415	海康威视	921,320.98	3.87
51	601211	国泰君安	916,316.99	3.85
52	002094	青岛金王	872,568.00	3.67
53	002736	国信证券	871,400.00	3.67
54	601318	中国平安	858,439.00	3.61
55	300327	中颖电子	853,467.46	3.59
56	600667	太极实业	840,350.00	3.53
57	600779	水井坊	834,318.59	3.51
58	600887	伊利股份	826,606.00	3.48
59	601111	中国国航	819,894.00	3.45
60	600596	新安股份	814,051.00	3.42
61	000997	新大陆	809,250.00	3.40
62	002434	万里扬	802,728.00	3.38
63	000596	古井贡酒	800,916.00	3.37
64	002643	万润股份	780,783.00	3.28

65	601688	华泰证券	766,836.00	3.23
66	600004	白云机场	764,127.00	3.21
67	002007	华兰生物	754,368.00	3.17
68	600171	上海贝岭	748,605.00	3.15
69	600426	华鲁恒升	743,422.00	3.13
70	002019	亿帆医药	734,478.00	3.09
71	002268	卫 士 通	722,768.00	3.04
72	300101	振芯科技	721,877.00	3.04
73	600999	招商证券	720,800.00	3.03
74	002049	紫光国芯	717,214.00	3.02
75	000663	永安林业	715,703.00	3.01
76	000776	广发证券	714,937.00	3.01
77	002035	华帝股份	714,768.00	3.01
78	002572	索菲亚	714,747.00	3.01
79	601377	兴业证券	707,332.00	2.97
80	002383	合众思壮	707,205.00	2.97
81	300224	正海磁材	707,022.00	2.97
82	600297	广汇汽车	690,311.53	2.90
83	300408	三环集团	686,700.00	2.89
84	002294	信立泰	679,115.32	2.86
85	600161	天坛生物	676,960.00	2.85
86	002456	欧菲光	672,639.00	2.83
87	002463	沪电股份	667,385.00	2.81
88	603198	迎驾贡酒	651,047.00	2.74
89	300418	昆仑万维	644,893.00	2.71
90	603868	飞科电器	644,302.00	2.71
91	002271	东方雨虹	637,180.00	2.68
92	600460	士兰微	633,991.00	2.67
93	002482	广田集团	633,133.00	2.66
94	603708	家家悦	632,040.00	2.66
95	002429	兆驰股份	624,700.00	2.63
96	601668	中国建筑	621,000.00	2.61
97	002727	一心堂	618,758.00	2.60
98	002251	步 步 高	617,873.00	2.60
99	002680	长生生物	615,800.00	2.59
100	600389	江山股份	602,584.50	2.53
101	601888	中国国旅	597,965.00	2.51
102	002043	兔 宝 宝	596,612.00	2.51

103	002410	广联达	595,461.00	2.50
104	600713	南京医药	589,888.00	2.48
105	000796	凯撒旅游	580,351.38	2.44
106	601100	恒立液压	580,183.00	2.44
107	601800	中国交建	575,751.00	2.42
108	600406	国电南瑞	574,700.00	2.42
109	002326	永太科技	572,669.47	2.41
110	300206	理邦仪器	566,200.00	2.38
111	002120	韵达股份	564,342.80	2.37
112	600804	鹏博士	564,001.00	2.37
113	600270	外运发展	563,661.00	2.37
114	300228	富瑞特装	559,080.00	2.35
115	000333	美的集团	553,126.00	2.33
116	000708	大冶特钢	550,168.00	2.31
117	002773	康弘药业	548,507.00	2.31
118	002664	信质电机	545,133.00	2.29
119	600889	南京化纤	541,315.00	2.28
120	603188	亚邦股份	541,271.00	2.28
121	603558	健盛集团	539,711.00	2.27
122	000002	万科A	537,120.00	2.26
123	600309	万华化学	532,709.00	2.24
124	002407	多氟多	532,221.00	2.24
125	000166	申万宏源	530,700.00	2.23
126	002468	申通快递	528,460.00	2.22
127	600216	浙江医药	528,308.00	2.22
128	000651	格力电器	527,610.00	2.22
129	600987	航民股份	527,570.00	2.22
130	300207	欣旺达	521,800.00	2.19
131	600125	铁龙物流	519,600.00	2.19
132	000949	新乡化纤	519,000.00	2.18
133	002589	瑞康医药	516,911.00	2.17
134	600963	岳阳林纸	514,800.00	2.17
135	600233	圆通速递	509,590.00	2.14
136	002508	老板电器	505,582.00	2.13
137	600729	重庆百货	505,300.00	2.13
138	000681	视觉中国	504,741.00	2.12
139	002281	光迅科技	501,230.00	2.11
140	600271	航天信息	499,781.00	2.10

141	000501	鄂武商 A	498,192.00	2.10
142	600340	华夏幸福	497,172.00	2.09
143	300115	长盈精密	496,076.00	2.09
144	300075	数字政通	495,948.00	2.09
145	002079	苏州固锔	493,342.72	2.07
146	002611	东方精工	485,089.00	2.04
147	002245	澳洋顺昌	484,060.00	2.04
148	300373	扬杰科技	479,605.00	2.02
149	002146	荣盛发展	479,250.00	2.02
150	603883	老百姓	477,011.97	2.01
151	002562	兄弟科技	476,200.00	2.00

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	175,474,282.47
卖出股票收入（成交）总额	160,473,710.96

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本报告期，本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	51,182.09
2	应收证券清算款	4,458,033.64
3	应收股利	-

4	应收利息	-62.67
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,509,153.06

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
496	46,044.29	10,496,229.50	45.96%	12,341,738.99	54.04%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

注：基金管理人的从业人员，是指在基金管理人负责公募基金管理业务或者实际履行公募基金管理业务相应职责的人员以及可能接触公募基金管理业务未公开信息的人员，不包括与公募基金管理业务不直接相关的其他业务部门以及后台职能部门的工作人员。

9.3 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

注：基金管理人的从业人员，是指在基金管理人负责公募基金管理业务或者实际履行公募基金管理业务相应职责的人员以及可能接触公募基金管理业务未公开信息的人员，不包括与公募基金管理业务不直接相关的其他业务部门以及后台职能部门的工作人员。

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,000.00	43.79	10,001,000.00	43.79	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—

基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,000.00	43.79	10,001,000.00	43.79	3 年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2017 年 7 月 3 日 ）基金份额总额	63,791,190.90
本报告期期初基金份额总额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	242,324.35
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	41,195,546.76
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
本报告期期末基金份额总额	22,837,968.49

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

1、根据基金管理人国都证券股份有限公司（简称“公司”）经营管理工作需要，经研究决定，由公司副总经理赵远峰分管公募基金管理业务，公司总经理常喆不再分管基金管理部的工作。根据《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》、《关于公募基金行业高级管理人员资质测试和任免信息报送事项的通知》等的相关规定以及《公募基金管理人高级管理人员任职备案函》（中基协高备函[2017]141 号），公司副总经理赵远峰已取得公募基金行业高级管理人员任职资格，并于 2017 年 6 月 6 日开始正式履职。公司已在指定报刊及公司官网公告其履任信息，并向中国证监会北京监管局进行报备。

2、根据基金管理人国都证券股份有限公司（简称“公司”）公募基金管理业务经营管理的需要，经公司总经理办公会表决同意，由公司副总经理赵远峰（现分管公募基金管理业务）担任基金管理部总经理，廖晓东不再担任该职务。公司已于 2017 年 9 月 13 日通过指定报刊和公司官网等媒介披露了相关公告，并向中国证监会北京监管局进行报备。

3、根据基金管理人国都证券股份有限公司（简称“公司”）公募基金管理业务经营管理的需要，经公司总经理办公会表决同意，由廖晓东担任基金管理部总经理，公司副总经理赵远峰（仍分管公募基金管理业务），不再担任该职务。公司已于 2017 年 11 月 14 日通过指定报刊和公司官网等媒介披露了相关公告，并向中国证监会北京监管局进行报备。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

本报告期内，涉及基金管理人的其他诉讼共 12 件，包括 1 件分支机构涉及的房屋租赁合同纠纷案件，1 件分支机构涉及的劳动争议案件，3 件公司总部涉及的劳动争议案件，7 件分支机构涉及的著作权权属、侵权纠纷，均与基金管理业务无关，均不会对基金管理人日常经营造成重大影响，亦不会对基金管理人履行基金管理职责造成影响。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，有媒体报道基金管理人原董事长王少华先生正在接受检察机关调查，但基金管理人未收到有关机关/部门的正式书面通知。基金管理人于 2017 年 7 月 21 日发布了《关于公司董事长不能正常履职的公告》，于 2017 年 8 月 1 日收到王少华先生的辞职信，于 2017 年 8 月 3 日发布了《国都证券董事变动公告（辞职情况）》。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
国都证券股 份有限公司		2335,947,993.43	100.00%	309,487.62	100.00%	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、本基金合同于 2017 年 7 月 3 日生效，自基金成立日起本基金与托管在同一托管行（兴业银行）的公司其他基金公用上述交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
国都证券股 份有限公司	—	—	667,500,000.00	100.00%	—	—

11.8 其他重大事件

注：无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2017/08/11-2017/12/31	10,001,000.00	-	-	10,001,000.00	43.79%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金管理人发起资金持有份额比例超过基金总份额的 20%且持有比例较大，除本基金招募说明书中列示的各项风险情形外，还包括因该类投资者巨额赎回可能导致的基金清盘风险和基金净值波动风险。</p> <p>根据基金合同及相关法律法规约定，自基金成立之日起，基金管理人的发起资金持有基金份额不得少于 3 年，报告期内，本基金未发生上述相关风险事项。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

王少华先生原在基金管理人国都证券股份有限公司（简称“公司”）担任董事长职务。2017 年 7 月 21 日，公司发布了《关于公司董事长不能正常履职的公告》；2017 年 7 月 24 日，公司在北京召开了第一届董事会第十二次会议（临时会议），会议同意已经半数以上董事推举的翁振杰董事在法定期限内代行董事长职责至董事会选举出董事长之日止。2017 年 8 月 1 日，王少华先生因个人原因，辞去公司董事职务，王少华先生辞职后不再担任公司其他职务。2017 年 12 月 8 日公司第一届董事会第十五次会议（临时会议）选举翁振杰董事为公司第一届董事会董事长。翁振杰董事担任公司董事长的任职资格尚需中国证券监管机构核准。公司已就上述事项在全国中小企业股份转让系统发布了相关公告。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 2、《国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站 www.guodu.com

13.3 查阅方式

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

国都证券股份有限公司

2018 年 3 月 27 日