

国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金 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 1 月 1 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.....	13
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.....	14
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	49
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53

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	54
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	54
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	54
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
8.12 投资组合报告附注	55
§9 基金份额持有人信息	56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§10 开放式基金份额变动	57
§11 重大事件揭示	58
11.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
11.4 基金投资策略的改变	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8 其他重大事件	60
§12 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§13 备查文件目录	62
13.1 备查文件目录	62
13.2 存放地点	62
13.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金
基金简称	国都聚鑫定期开放
场内简称	-
基金主代码	003856
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	2016 年 12 月 21 日
基金管理人	国都证券股份有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	397,084,958.00 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	在谨慎投资的前提下，本基金力争超越业绩比较基准，追求基金资产的稳健增值
投资策略	本基金跟踪和分析宏观经济数据，通过定性与定量分析，对经济形势及未来发展趋势进行判断，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中国债券总指数收益率×60%+沪深 300 指数收益率×40%
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	2016 年 12 月 21 日 (基金合同生效 日)-2016 年 12 月 31 日	2015 年
本期已实现收益	30,934,974.21	341,790.10	-
本期利润	30,490,243.94	343,358.10	-
加权平均基金份额本期利润	0.0768	0.0009	-
本期加权平均净值利润率	7.37%	0.09%	-
本期基金份额净值增长率	7.66%	0.09%	-
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	30,824,115.90	341,790.10	-
期末可供分配基金份额利润	0.0776	0.0009	-
期末基金资产净值	427,909,073.90	397,551,533.34	-
期末基金份额净值	1.0776	1.0009	-
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	7.76%	0.09%	-

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、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

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

3.2 基金净值表现

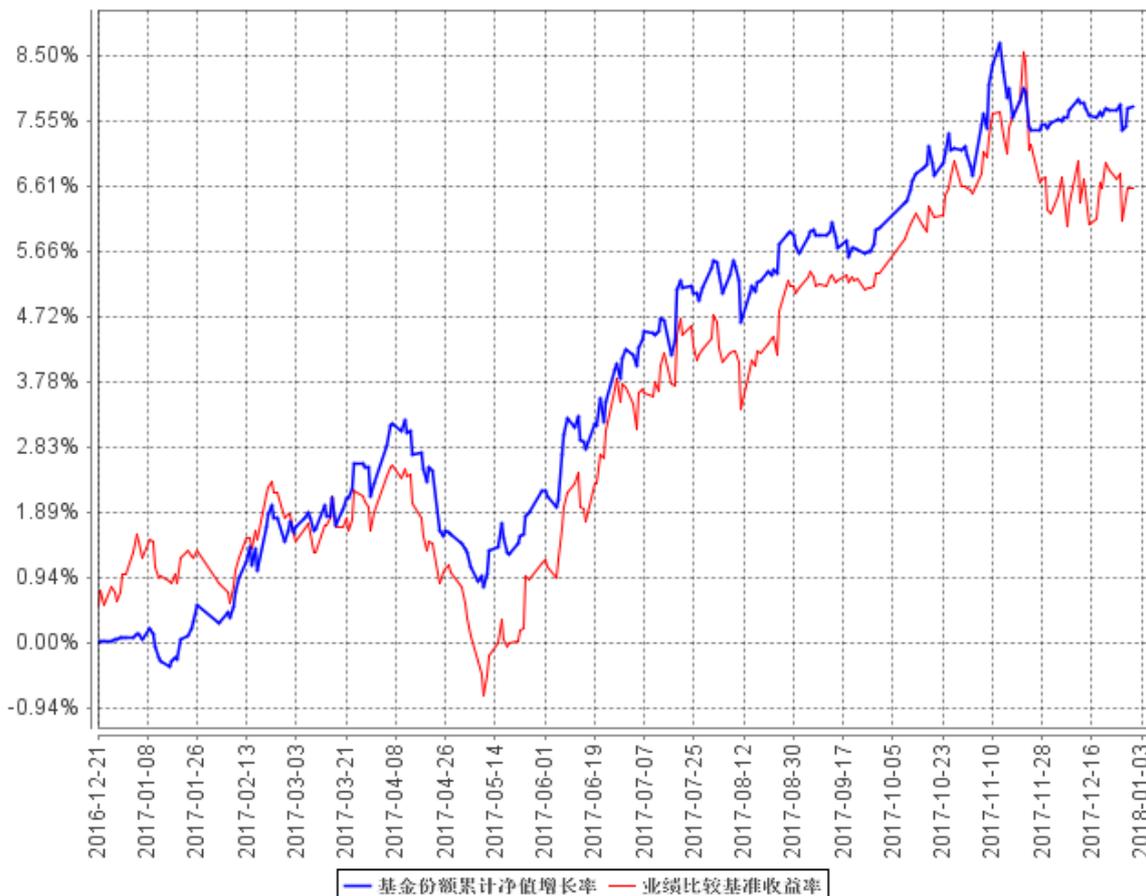
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.66%	0.20%	1.17%	0.32%	0.49%	-0.12%
过去六个月	3.36%	0.20%	2.79%	0.27%	0.57%	-0.07%
过去一年	7.66%	0.21%	5.54%	0.26%	2.12%	-0.05%

自基金合同生效起至今	7.76%	0.20%	6.59%	0.26%	1.17%	-0.06%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------

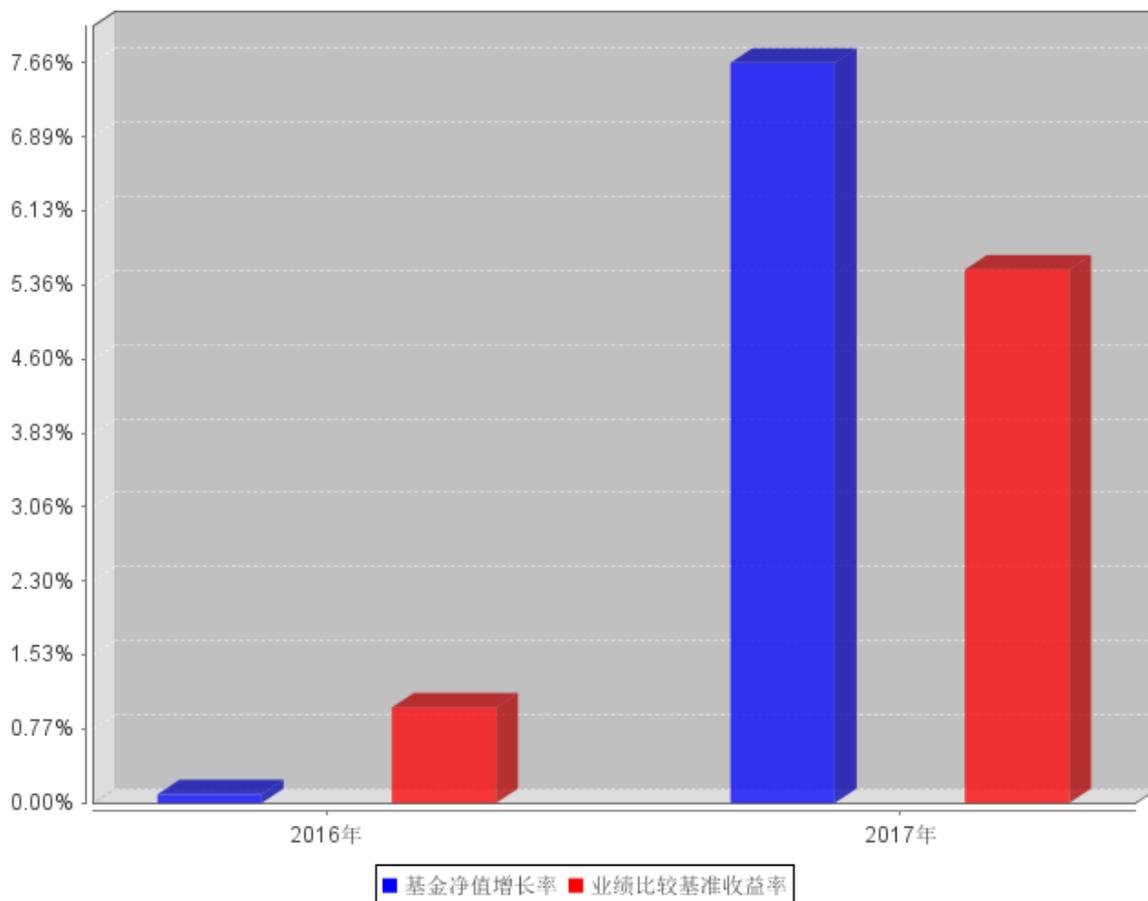
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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：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		
张崴	基金经理	2016 年 12 月 21 日	-	10 年	硕士。历任国都证券经纪业务总部、国都证券研究所地产行业研究员、电气设备及新能源行业研究员。现任国都证券基金管理部基金经理、公募证券投资基金管理业务投资决策委员会成员。
杨鹏飞	基金经理	2017 年 6 月 29 日	-	6 年	经济学硕士，曾任中航证券有限公司金融研究所债券研究员、高级债券研究员，中航证券有限公司融资理财部高级投资经理，国都证券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《国都聚鑫定期开放混合型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，宏观经济平稳较快增长，消费占比持续提升，房地产、制造业投资增速保持较快增长，外需好转带动净出口全年同比大幅转正。同时，国内经济结构调整效果显现，经济增长质量提升，各行业竞争格局优化，龙头公司盈利能力明显提升。在业绩增长与投资者结构机构化的双

重推动下，2017 年全年 A 股呈现明显两极分化特征，龙头白马公司估值大幅修复，而中小创中业绩增速放缓且估值过高的个股全年维持弱势。金融市场上，防风险、去杠杆与严监管贯穿全年，委外与同业业务大幅收缩，利率趋势性上行，且上行幅度巨大。与此同时，货币紧缩之下，负债率较高的企业融资能力受限，频频出现信用风险，低等级信用债被抛售。

报告期内，本基金在大类资产上，以持有固定收益类和权益类资产为主。其中，固定收益投资上，全年维持防御策略，在债券熊市当中保持住了定力，短久期、中高评级策略取得较好效果。股票标的选择上，以行业内竞争能力强、有业务壁垒、业绩增长确定性较高且估值不明显高估的龙头公司为主。我们判断，中国各行各业集中度提升的进程还远远没有走完，并且随着技术不断更新迭代，未来龙头公司的平台优势会更加明显，强者恒强的态势将继续演绎，本基金未来将继续挖掘业绩快速增长的优质公司，为投资者带来可持续的长期回报。

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 1.0776 元，份额累计净值 1.0776 元，年度基金份额净值增长率 7.66%。同期基金业绩比较基准 5.54%，本基金份额净值增长率高于业绩比较基准 2.12 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

进入 2018 年，全球范围内不确定因素增多。从外围看，美国进入加息周期，美债利率持续走高，虽然非农就业数据及 PMI 等经济指标仍然保持较好水平，但投资者对持续加息后经济衰退的担忧有所升温。同时，美国贸易保护动作频频，全球贸易摩擦事件预计会明显增加。国内看，经济工作会议定调未来三年三大攻坚战，金融防风险被列为首位，预计后续金融去杠杆相关政策将持续不断推出，同时，总理工作报告主动调低赤字率，地方政府基础设施建设的力度将明显放缓，创新发展领域的增量贡献与净出口的走势将对 2018 年宏观经济起到重要的边际力量作用。

去杠杆已经取得初步成效，货币政策稳健中性，同时注意松紧有度，整体流动性预计会略好于去年。金融监管继续推进，资管新规有望不久落地，在资产管理业务增量得到严格控制之后，金融生态重塑进入存量优化为主的阶段，影响或小于去年。美债利率快速上行之后，中美利差现处于均值之下，外部利率还会对我国利率形成牵制。总体来看，继去年大幅上升之后，利率今年有望进入高位震荡局面。

在这样的背景下，二级股票市场上，我们判断从 2016 年开始的这轮供给侧改革下，基建和房地产投资快速增长所带来的中上游领域的主体投资机会已经过去，而十九大中提出的“加快建设

科技强国”或可成为未来主要投资机会的指引，智能制造投资机会方兴未艾。同时，考虑到全球货币收紧和国内金融去杠杆的大环境，权益类市场投资者风险偏好难以大幅提升，在股票选择上要更加重视公司的业绩成长能力，深挖投资价值。

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，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者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

本报告期，兴业银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

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]1038 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	国都聚鑫定期开放混合型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 年度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：国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金

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	410,949.38	46,718,505.01
结算备付金		5,494,805.59	-
存出保证金		160,618.29	-
交易性金融资产	7.4.7.2	304,937,578.88	1,005,789.00
其中：股票投资		68,298,286.18	1,005,789.00
基金投资		-	-
债券投资		236,639,292.70	-
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	105,000,525.00	396,001,980.00
应收证券清算款		6,697,811.84	-
应收利息	7.4.7.5	5,768,084.84	71,620.92
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		428,470,373.82	443,797,894.93
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		-	46,121,740.48
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		290,527.21	86,854.48
应付托管费		79,894.99	23,884.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	60,877.72	13,881.65
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	130,000.00	-
负债合计		561,299.92	46,246,361.59
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	397,084,958.00	397,208,175.24
未分配利润	7.4.7.10	30,824,115.90	343,358.10
所有者权益合计		427,909,073.90	397,551,533.34
负债和所有者权益总计		428,470,373.82	443,797,894.93

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0776 元，基金份额总额 397,084,958.00 份。

7.2 利润表

会计主体：国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 12 月 21 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		36,796,917.55	455,101.78
1. 利息收入		12,669,597.80	453,533.78
其中：存款利息收入	7.4.7.11	310,700.20	97,820.85
债券利息收入		9,925,752.05	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,433,145.55	355,712.93
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		24,571,967.06	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	23,326,279.70	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-964,647.24	-
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	2,210,334.60	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-444,730.27	1,568.00
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	82.96	-
减：二、费用		6,306,673.61	111,743.68

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,304,676.85	86,854.48
2. 托管费	7.4.10.2.2	908,786.24	23,884.98
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,931,107.26	1,004.22
5. 利息支出		944.30	-
其中：卖出回购金融资产支出		944.30	-
6. 其他费用	7.4.7.20	161,158.96	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		30,490,243.94	343,358.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		30,490,243.94	343,358.10

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1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）	397,208,175.24	343,358.10	397,551,533.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,490,243.94	30,490,243.94
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）	-123,217.24	-9,486.14	-132,703.38
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-123,217.24	-9,486.14	-132,703.38
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）	397,084,958.00	30,824,115.90	427,909,073.90
项目	上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同生效日)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）	397,208,175.24	-	397,208,175.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	343,358.10	343,358.10
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）	397,208,175.24	343,358.10	397,551,533.34

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

基金管理人负责人

李蔚

主管会计工作负责人

封欣

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2016 年 11 月 16 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金注册的批复》证监许可〔2016〕2725 号文核准注册，自 2016 年 12 月 8 日至 2016 年 12 月 15 日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 397,208,118.04 元人民币，并经中准会计师事务所（特殊普通合伙）“中准验字[2016]第 1205 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金合同》于 2016 年 12 月 21 日正式生效。

基金合同生效日的基金份额总额为 397,208,175.24 份基金单位，其中认购资金利息折合 57.20 份基金单位。

本基金基金管理人为国都证券股份有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金合同》的有关规定，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、国债期货、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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》、《国都聚鑫定期开放混合型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

本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日，期间的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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日。比较期间财务报表的实际编制期间为 2016 年 12 月 21 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。

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和债券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。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；或者(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

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

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。当本基金依法 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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或者发行价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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
活期存款	410,949.38	46,718,505.01
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	410,949.38	46,718,505.01

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	68,120,855.28	68,298,286.18	177,430.90	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	56,478,195.18	55,827,532.70	-650,662.48
	银行间市场	180,781,690.69	180,811,760.00	30,069.31
	合计	237,259,885.87	236,639,292.70	-620,593.17
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	

其他	-	-	-
合计	305,380,741.15	304,937,578.88	-443,162.27
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	1,004,221.00	1,005,789.00	1,568.00
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	1,004,221.00	1,005,789.00	1,568.00

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	105,000,525.00	-
合计	105,000,525.00	-
项目	上年度末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	396,001,980.00	-
合计	396,001,980.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购余额，故未存在因此取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	11,307.60	62,071.12
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	2,719.97	-
应收债券利息	5,803,291.31	-
应收买入返售证券利息	-49,313.57	9,549.80
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	79.53	-
合计	5,768,084.84	71,620.92

注：“其他”为结算保证金利息收入。

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	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	59,702.72	13,881.65
银行间市场应付交易费用	1,175.00	-
合计	60,877.72	13,881.65

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	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	130,000.00	-
合计	130,000.00	-

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	397,208,175.24	397,208,175.24

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-123,217.24	-123,217.24
- 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	397,084,958.00	397,084,958.00

注：1. 本基金自 2016 年 12 月 8 日至 2016 年 12 月 15 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 397,208,118.04 元。根据《国都聚鑫定期开放混合型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人民币 57.20 元在本基金成立后，折算为 57.20 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

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
上年度末	341,790.10	1,568.00	343,358.10
本期利润	30,934,974.21	-444,730.27	30,490,243.94
本期基金份额交易产生的变动数	-9,620.77	134.63	-9,486.14
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-9,620.77	134.63	-9,486.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,267,143.54	-443,027.64	30,824,115.90

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	227,048.90	97,820.85
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	81,430.60	-
其他	2,220.70	-
合计	310,700.20	97,820.85

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1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年12月21日(基金 合同生效日)至2016年12月 31日
卖出股票成交总额	626,744,368.16	-
减：卖出股票成本总额	603,418,088.46	-
买卖股票差价收入	23,326,279.70	-

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

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年12月21日(基金 合同生效日)至2016年12月 31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	-964,647.24	-
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	-964,647.24	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年12月21日(基金 合同生效日)至2016年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额	549,156,899.55	-
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	539,585,514.84	-
减：应收利息总额	10,536,031.95	-
买卖债券差价收入	-964,647.24	-

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：本基金本报告期间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：本基金在本报告期未进行贵金属投资。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金在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：本基金在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：本基金在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：本基金本报告期无衍生工具投资。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同生效日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,210,334.60	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,210,334.60	-

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1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年12月21日(基金合 同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-444,730.27	1,568.00
——股票投资	175,862.90	1,568.00
——债券投资	-620,593.17	-
——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	-444,730.27	1,568.00

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同生效 日)至2016年12月31日
基金赎回费收入	82.96	-
合计	82.96	-

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同生 效日)至2016年12月31日
交易所市场交易费用	1,925,657.26	1,004.22
银行间市场交易费用	5,450.00	-
合计	1,931,107.26	1,004.22

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年	上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同
----	-----------------------	-----------------------------

	12 月 31 日	生效日)至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	-
信息披露费	100,000.00	-
银行划款手续费	7,558.96	-
证券账户开户费	400.00	-
账户维护费	22,500.00	-
查询服务费	700.00	-
合计	161,158.96	-

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、关联方报酬等情况，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。

7.4.10.1 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1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同生效日)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	1,293,088,899.40	100.00%	1,004,221.00	100.00%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同生效日)至2016 年12月31日	
	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 成交总额的比 例
国都证券股 份有限公司	58,183,985.72	100.00%	-	-

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1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同生效日)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	10,657,600,000.00	100.00%	2,151,300,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未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1月1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	1,266,374.25	100.00%	59,702.72	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同生效日)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
国都证券股 份有限公司	13,881.65	100.00%	13,881.65	100.00%

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。

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1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同生效 日)至2016年12月31日
	当期发生的基金应支付 的管理费	3,304,676.85
其中：支付销售机构的客 户维护费	-	-

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	908,786.24	23,884.98

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

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。

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：本基金本报告期内未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

注：报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		2016 年 12 月 21 日(基金合同生效日)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
兴业银行股份有限公司	410,949.38	227,048.90	46,718,505.01	97,820.85

注：1、本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

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：本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

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：本报告期末，本基金未持有因认购新发/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
300730	科创信息	2017年12月25日	重大事项	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	重大事项	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

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：本报告期末，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，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

7.4.13.2.2 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，可流通股股票资产变现天数低于 1 天。本基金成立于 2016 年 12 月 21 日，最大单一投资者持有开放式基金份额超过基金总份额 50%，报告期内未再接受该单一投资者的申购。本基金持有资产以交易所、银行间市场正常交易的股票、债券以及国债逆回购等高流动性资产为主，总体上能够达到可变现资产覆盖单一机构投资者赎回的要求。

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 201 7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	410,949.38	-	-	-	-	-	410,949.38
结算备付金	5,494,805.59	-	-	-	-	-	5,494,805.59
存出保证金	160,618.29	-	-	-	-	-	160,618.29
交易性金融资产	40,339,980.00	63,321,085.00	109,875,300.00	23,102,927.70	-	68,298,286.18	304,937,578.88

产							
买入返售金融资产	105,000,000.00	-	-	-	-	525.00	105,000,525.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	6,697,811.84	6,697,811.84
应收利息	-	-	-	-	-	5,768,084.84	5,768,084.84
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	151,406,353.26	63,321,085.00	109,875,300.00	23,102,927.70	-	80,764,707.86	428,470,373.82
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	290,527.21	290,527.21
应付托管费	-	-	-	-	-	79,894.99	79,894.99
应付	-	-	-	-	-	60,877.72	60,877.72

交易费用							
其他负债						130,000.00	130,000.00
负债总计						561,299.92	561,299.92
利率敏感度缺口	151,406,353.26	63,321,085.00	109,875,300.00	23,102,927.70		-80,203,407.94	427,909,073.90
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							
银行存款	46,718,505.01						-46,718,505.01
交易性金融资产						1,005,789.00	1,005,789.00
买入返	396,000,000.00					1,980.00	396,001,980.00

售金融资产							
应收利息	-	-	-	-	-	71,620.92	71,620.92
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	442,718,505.01	-	-	-	-	1,079,389.92	443,797,894.93
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	46,121,740.48	46,121,740.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	86,854.48	86,854.48
应付托管费	-	-	-	-	-	23,884.98	23,884.98
应付交易费用	-	-	-	-	-	13,881.65	13,881.65
其	-	-	-	-	-	-	-

他 负 债						
负 债 总 计		-	-	-	-	46,246,361.59
利 率 敏 感 度 缺 口	442,718,505.01	-	-	-	-	-45,166,971.67
						397,551,533.34

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。

7.4.13.4.1.2 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（2017年12月31日）	上年度末（2016年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	228,902.42	-
市场利率上升 25 个基点	-228,902.42	-	

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，所面临的最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	68,298,286.18	15.96	1,005,789.00	0.25
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	236,639,292.70	55.30	-	-
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	304,937,578.88	71.26	1,005,789.00	0.25

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%	-3,821,010.32	-
	沪深 300 指数上涨 5%	3,821,010.32	-

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 2,233,494.23 元，占基金资产净值比例为 0.52%。

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 68,235,225.17 元，属于第二层次的余额为 236,702,353.71 元、第三层次无余额。

(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	68,298,286.18	15.94
	其中：股票	68,298,286.18	15.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	236,639,292.70	55.23
	其中：债券	236,639,292.70	55.23
	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	105,000,525.00	24.51
	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	5,905,754.97	1.38
8	其他各项资产	12,626,514.97	2.95
9	合计	428,470,373.82	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	51,689,889.63	12.08
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	1,140,744.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.01
J	金融业	9,796,800.00	2.29
K	房地产业	5,636,740.00	1.32

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	68,298,286.18	15.96

注：以上行业分类以 2017 年 12 月 31 日的中国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投资股票。

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	601988	中国银行	1,000,000	3,970,000.00	0.93
2	600703	三安光电	150,000	3,808,500.00	0.89
3	600089	特变电工	380,000	3,765,800.00	0.88
4	000002	万科A	106,000	3,292,360.00	0.77
5	603338	浙江鼎力	41,200	3,239,968.00	0.76
6	600031	三一重工	350,000	3,174,500.00	0.74
7	603337	杰克股份	59,900	3,087,246.00	0.72
8	000039	中集集团	134,882	3,082,053.70	0.72
9	002202	金风科技	156,000	2,940,600.00	0.69
10	002415	海康威视	74,800	2,917,200.00	0.68
11	002001	新和成	76,000	2,892,560.00	0.68
12	300316	晶盛机电	138,000	2,885,580.00	0.67
13	002146	荣盛发展	246,000	2,344,380.00	0.55
14	600298	安琪酵母	70,000	2,290,400.00	0.54
15	601688	华泰证券	130,000	2,243,800.00	0.52
16	300274	阳光电源	118,100	2,216,737.00	0.52
17	300408	三环集团	100,000	2,016,000.00	0.47
18	601288	农业银行	500,000	1,915,000.00	0.45
19	603938	三孚股份	44,000	1,801,800.00	0.42
20	600741	华域汽车	60,000	1,781,400.00	0.42

21	000776	广发证券	100,000	1,668,000.00	0.39
22	002271	东方雨虹	41,200	1,646,352.00	0.38
23	300097	智云股份	52,000	1,476,800.00	0.35
24	300545	联得装备	19,000	1,240,700.00	0.29
25	300296	利亚德	60,000	1,169,400.00	0.27
26	002640	跨境通	59,600	1,140,744.00	0.27
27	300567	精测电子	8,000	1,066,720.00	0.25
28	600835	上海机电	40,000	980,000.00	0.23
29	002557	洽洽食品	36,000	568,440.00	0.13
30	300604	长川科技	8,700	539,400.00	0.13
31	601233	桐昆股份	22,000	494,780.00	0.12
32	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.06
33	002915	中欣氟材	4,337	152,619.03	0.04
34	600426	华鲁恒升	8,000	127,360.00	0.03
35	300730	科创信息	821	34,112.55	0.01
36	603289	泰瑞机器	1,596	30,403.80	0.01
37	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.01

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	601398	工商银行	26,155,623.00	6.58
2	000001	平安银行	20,063,846.80	5.05
3	601288	农业银行	15,446,000.00	3.89
4	601939	建设银行	13,011,400.00	3.27
5	601988	中国银行	12,567,940.00	3.16
6	000002	万科A	11,558,188.00	2.91
7	000963	华东医药	10,486,445.00	2.64
8	002202	金风科技	10,378,911.37	2.61
9	600298	安琪酵母	10,036,377.00	2.52
10	002271	东方雨虹	9,922,200.00	2.50
11	000488	晨鸣纸业	8,977,021.00	2.26
12	601328	交通银行	8,958,030.00	2.25

13	002456	欧菲光	8,421,757.06	2.12
14	601111	中国国航	8,355,600.00	2.10
15	600089	特变电工	7,566,750.00	1.90
16	002241	歌尔股份	7,392,431.00	1.86
17	601607	上海医药	7,104,620.00	1.79
18	002008	大族激光	6,839,076.00	1.72
19	002415	海康威视	6,764,844.00	1.70
20	002465	海格通信	6,757,028.00	1.70

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 累计卖出金额超初期基金资产净值 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	601398	工商银行	29,000,664.00	7.29
2	000001	平安银行	21,432,860.62	5.39
3	601288	农业银行	14,856,000.00	3.74
4	601939	建设银行	14,075,900.00	3.54
5	000963	华东医药	11,370,846.38	2.86
6	002456	欧菲光	9,629,100.00	2.42
7	601988	中国银行	9,541,580.00	2.40
8	002271	东方雨虹	9,498,445.94	2.39
9	601328	交通银行	9,299,968.00	2.34
10	000488	晨鸣纸业	9,165,766.00	2.31
11	601111	中国国航	8,754,912.00	2.20
12	600298	安琪酵母	8,496,890.00	2.14
13	000002	万科A	8,279,350.00	2.08
14	002008	大族激光	7,836,049.10	1.97
15	002202	金风科技	7,682,585.42	1.93
16	002241	歌尔股份	7,650,160.00	1.92
17	601607	上海医药	7,614,328.00	1.92
18	002440	闰土股份	6,611,922.00	1.66
19	002465	海格通信	6,537,507.60	1.64
20	002236	大华股份	6,515,111.46	1.64

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	670,534,722.74
卖出股票收入（成交）总额	626,744,368.16

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

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	2,308,737.70	0.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	988,900.00	0.23
	其中：政策性金融债	988,900.00	0.23
4	企业债券	52,529,895.00	12.28
5	企业短期融资券	50,138,190.00	11.72
6	中期票据	130,673,570.00	30.54
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	236,639,292.70	55.30

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

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	1382037	13 杭交投 MTN1	200,000	20,224,520.00	4.73
2	1382048	13 宁城建 MTN2	200,000	20,171,460.00	4.71
3	1382124	13 申通集 MTN1	200,000	20,121,980.00	4.70
4	011751029	17 宁沪高 SCP001	200,000	20,115,460.00	4.70
5	1382243	13 粤城建 MTN1	200,000	20,063,200.00	4.69

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投资。

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投资。

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

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

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

本基金在综合分析经济基本面、资金面和政策面的基础上，结合组合内各利率债持仓结构的基础上，按照“利率风险评估—套期保值比例计算—保证金、期现价格变化等风险控制”的流程，构建并实时调整利率债的套期保值组合。同时，结合套利策略和投机策略等多种交易策略，优化资产配置，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

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	160,618.29
2	应收证券清算款	6,697,811.84
3	应收股利	-
4	应收利息	5,768,084.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,626,514.97

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可转换债券投资。

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未存在流通受限情况。

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
264	1,504,109.69	396,999,000.00	99.98%	85,958.00	0.02%

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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年12月21日）基金份额总额	397,208,175.24
本报告期期初基金份额总额	397,208,175.24
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	123,217.24
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	397,084,958.00

注：总申购份额含转换入份额，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		21,293,088,899.40	100.00%	1,266,374.25	100.00%	-

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	成交金额	占当期权 证 成交总额

				的比例		的比例
国都证券	58,243,339.71	100.00%	10,657,600,000.00	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	2016 年 12 月 21 日至 2017 年 12 月 31 日	396,999,000.00	-	-	396,999,000.00	99.98%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>报告期内，因本基金中单一投资者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>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、《国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 2、《国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《国都聚鑫定期开放混合型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