国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金 2017年年度报告摘要

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

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国都聚鑫定期开放
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	0116938@cib.com.cn
客户服务电话		400-818-8118	95561
传真		010-84183311	021-62535823

2.4信息披露方式

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

§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	–

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。

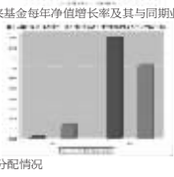
3.2 基金净值表现

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

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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
合计	–	–	–	–	

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		
张诚	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遵规守信情况的说明

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、中高等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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

–

4.10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	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。 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。 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。 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。
管理层和治理层对财务报表的责任	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。 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	田瘗 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		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		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		–	–
买入返售金融资产		105,000,525.00	396,001,980.00
应收证券清算款		6,697,811.84	–
应收利息		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		–	–
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		–	–
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		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		130,000.00	–
负债合计		561,299.92	46,246,361.59
所有者权益:			
实收基金		397,084,958.00	397,208,175.24
未分配利润		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		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		23,326,279.70	–
基金投资收益		–	–
债券投资收益		-964,647.24	–
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		2,210,334.60	–
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-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)		82.96	–
减:二、费用		6,306,673.61	111,743.68
1.管理人报酬	7.4.8.2.1	3,304,676.85	86,854.48
2.托管费	7.4.8.2.2	908,786.24	23,884.98
3.销售服务费	7.4.8.2.3	–	–
4.交易费用		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		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(本期净利润)	–	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(本期净利润)	–	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	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

–

7.4.5 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")、对于在制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 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。

7.4.8 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。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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%

7.4.8.1.2 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%	–	–

7.4.8.1.3 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%

7.4.8.1.4 权证交易

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	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 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	86,854.48
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×0.8%÷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。

7.4.8.2.2 基金托管费

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×0.22%÷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