

国都多策略混合型证券投资基金 2019 年年度报告

2019 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：2020 年 4 月 30 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 2020 年 4 月 27 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 2019 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 | 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 | 13 |
| §5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 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 | 14 |
| 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 | 14 |
| §6 审计报告 | 15 |
| 6.1 审计报告基本信息 | 15 |
| 6.2 审计报告的基本内容 | 15 |
| §7 年度财务报表 | 17 |
| 7.1 资产负债表 | 17 |
| 7.2 利润表 | 18 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 19 |
| 7.4 报表附注 | 20 |
| §8 投资组合报告 | 45 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 45 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合 | 45 |
| 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 | 46 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 47 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 49 |
| 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 | 50 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 50 |
| 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 | 50 |
| 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 | 50 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 50 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 50 |
| 8.12 投资组合报告附注 | 50 |
| §9 基金份额持有人信息 | 52 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 52 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 52 |
| 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 | 52 |
| §10 开放式基金份额变动 | 53 |
| §11 重大事件揭示 | 54 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 54 |
| 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 | 54 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 54 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 54 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 54 |
| 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 | 54 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 54 |
| 11.8 其他重大事件 | 55 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 | 56 |
| 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 | 56 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 56 |
| §13 备查文件目录 | 57 |
| 13.1 备查文件目录 | 57 |
| 13.2 存放地点 | 57 |
| 13.3 查阅方式 | 57 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|-----------------|
| 基金名称 | 国都多策略混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 国都多策略 |
| 场内简称 | — |
| 基金主代码 | 005264 |
| 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 | 2018 年 5 月 25 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 | 4,122,785.99 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 | 本基金将灵活运用多种投资策略，在严格控制风险并保证流动性的前提下，充分挖掘市场中潜在的投资机会，力争为基金份额持有人创造中长期稳健的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将综合运用定性和定量的分析方法，在对宏观经济进行深入研究的基础上，依据宏观经济周期所处阶段及变化趋势，结合估值水平、政策取向等因素，综合评估各大类资产的预期收益率和风险，合理确定本基金在股票、债券、权证、现金等大类资产之间的配置比例，以最大限度降低投资组合的风险、提高投资组合的收益。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×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 | 曾麓燕 |
| | 联系电话 | 010-84183229 | 021-52629999-212040 |
| | 电子邮箱 | lizhao@guodu.com | zengluyan@cib.com.cn |

| | | |
|--------|-------------------------------|----------------------|
| 客户服务电话 | 400-818-8118 | 95561 |
| 传真 | 010-84183311 | 021-62159217 |
| 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 | 上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼 |
| 邮政编码 | 100007 | 200041 |
| 法定代表人 | 翁振杰 | 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 | 中审华会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市西城区百万庄大街 22 号院 2 号楼 5 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 | 2019 年 | 2018 年 5 月 25 日 (基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 |
|---------------|--------------|--|---------|
| 本期已实现收益 | 3,454,254.08 | 1,110,494.27 | - |
| 本期利润 | 4,172,508.58 | 784,947.07 | - |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.4662 | 0.0138 | - |
| 本期加权平均净值利润率 | 38.66% | 1.38% | - |
| 本期基金份额净值增长率 | 39.71% | -2.50% | - |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2019 年末 | 2018 年末 | 2017 年末 |
| 期末可供分配利润 | 1,493,111.26 | -373,177.39 | - |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3622 | -0.0250 | - |
| 期末基金资产净值 | 5,615,897.25 | 14,548,988.08 | - |
| 期末基金份额净值 | 1.3622 | 0.9750 | - |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2019 年末 | 2018 年末 | 2017 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 36.22% | -2.50% | - |

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 2018 年 5 月 25 日生效，截至报告期末未满三年。

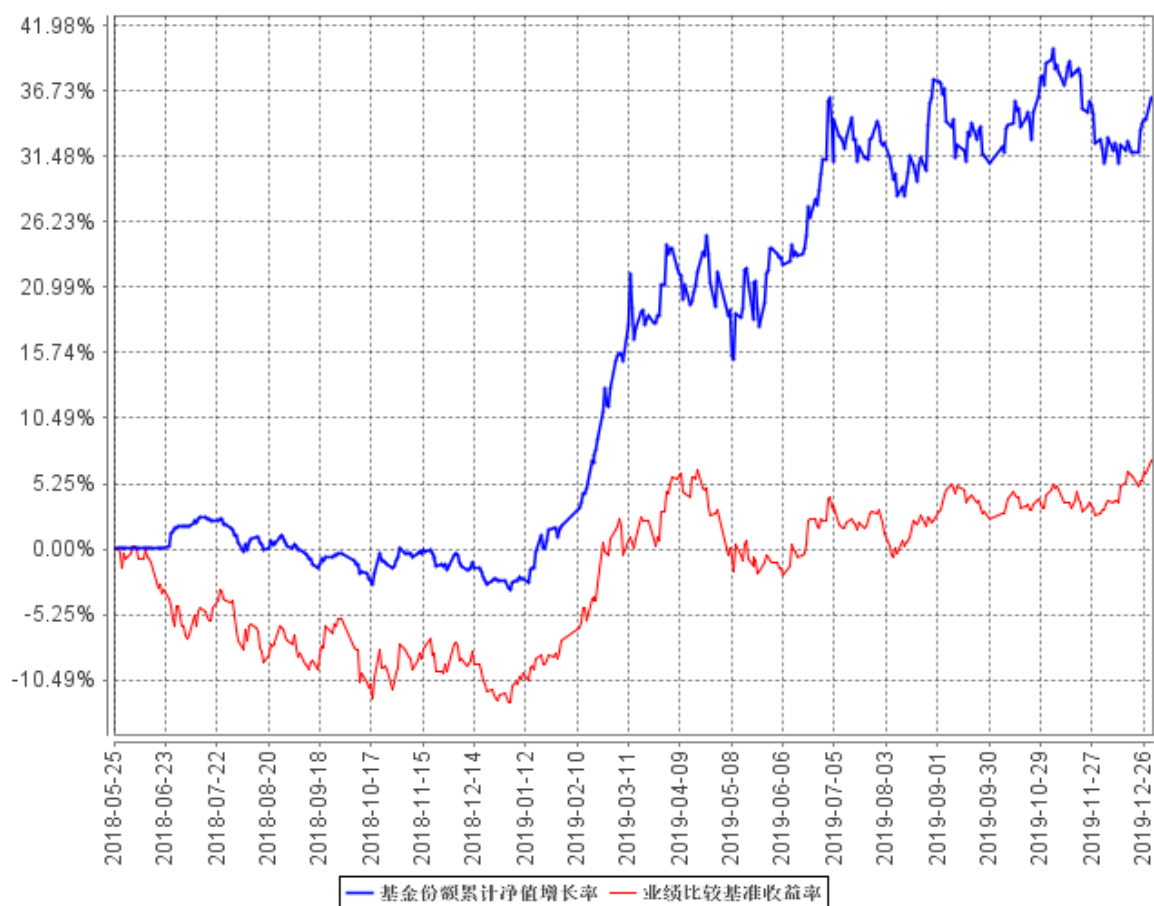
3.2 基金净值表现

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 | 3.96% | 0.77% | 4.77% | 0.44% | -0.81% | 0.33% |
| 过去六个月 | 3.76% | 0.95% | 4.92% | 0.51% | -1.16% | 0.44% |
| 过去一年 | 39.71% | 1.06% | 21.41% | 0.74% | 18.30% | 0.32% |
| 自基金合同生效起至今 | 36.22% | 0.86% | 7.27% | 0.79% | 28.95% | 0.07% |

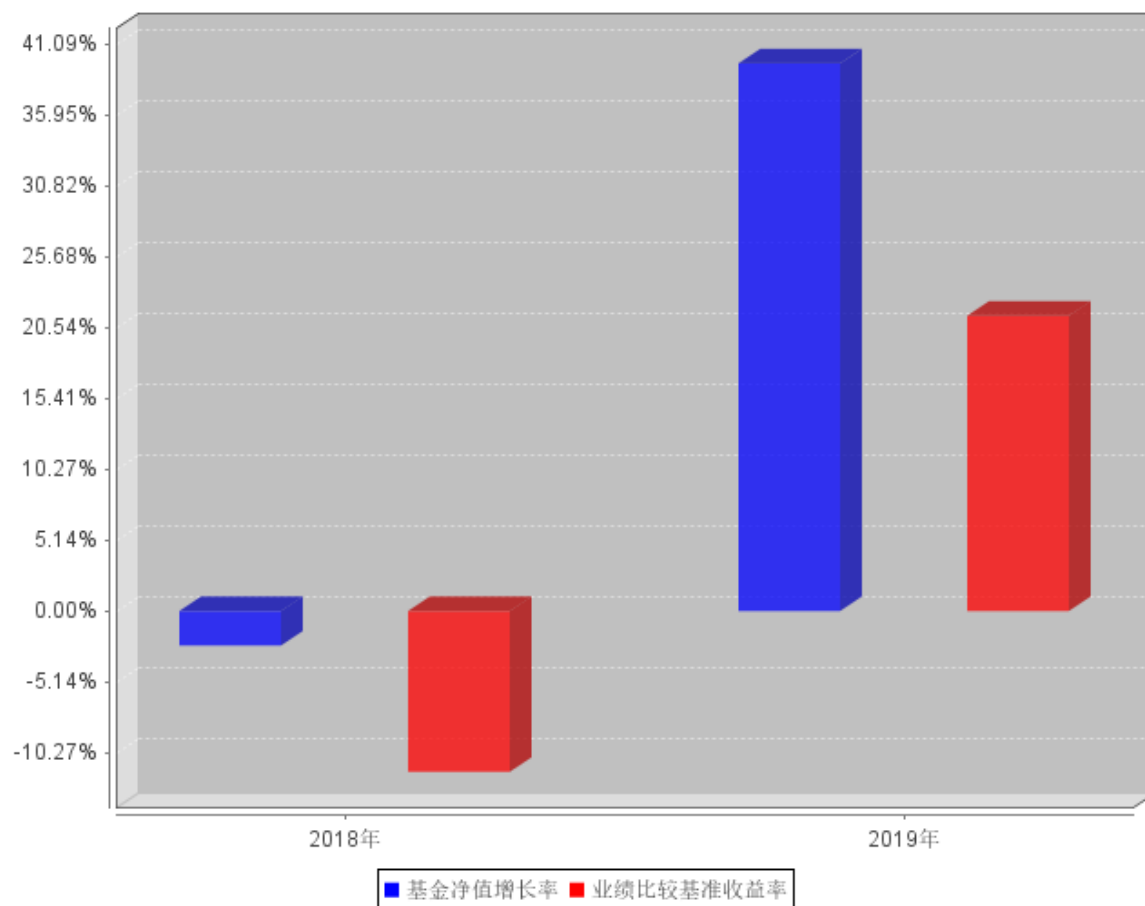
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 2018 年 5 月 25 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”。目前，注册资本为人民币 5,830,000,009 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 2019 年 12 月 31 日，本公司管理 5 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、国都多策略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 | | |
| 杨志刚 | 基金经理 | 2018 年 5 月 25 日 | — | 8 年 | 厦门大学经济系硕士。曾任中国证券报编辑；中航证券有限公司研究所高级销售经理；2011 年 7 月加入国都证券任旅游、家电行业研究员，现为国都证券股份有限公司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。 |
| 程广飞 | 基金经理 | 2018 年 5 月 25 日 | 2019 年 7 月 26 日 | 7 年 | 中科院研究生院工学硕士，北京科技大学计算机学士。2011 年毕业加入中国国际金融有限公司创新产品部担任分析师，随后任光大证券股份有限公司量化研究员，2013 年加入国都证券，曾担任研究所金融工程研究员、金融工程组负责 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 人，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。 |
|--|--|--|--|--|--|

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《国都多策略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

2019 年本基金保持了较高的仓位，全年平均仓位维持在 70% 左右，全年净值增长 39.71%。

报告期内，基金管理人认为 2019 年的走势是震荡筑底，有长期逻辑支撑、基本面较好的公司会有明显绝对收益。今年上半年，本基金主要配置了大消费行业的公司，取得了较好的绝对回报。今年下半年，消费类行业出现调整，本基金增加了先进制造业的配置，净值在 4 季度创出新高。

在行业选择方面，本基金长期看好大消费行业、医药、先进制造业、云计算、5G 等景气度持续时间较长的行业，在其中寻找商业模式好、技术壁垒高、品牌力强大、发展空间大的公司进行投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.3622 元，份额累计净值 1.3622 元，2019 年全年基金份额净值增长率 39.71%，同期基金业绩比较基准增长率 21.41%，本基金份额净值增长率高于业绩比较基准 18.30 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

展望后市，中国经济在四季度已经出现明显的企稳迹象，中美贸易关系得到逐步改善，各项有利于资本市场发展的法律法规渐次出台，市场情绪显著回暖，场外资金不断流入。我们认为，A 股已在 2019 年成功筑底，将在 2020 年震荡向上。本基金将继续坚持稳中求进的投资策略，逢低买入大众消费品、医药和先进制造业等行业中的优质公司，寻求风险收益比较高的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2019 年，公司高度重视基金的合规运作和风险管理，始终坚持保障基金份额持有人利益的原则，不断完善内部控制制度和业务流程，强化执行力度，培养合规文化，并有效地组织开展监察稽核工作，具体包括以下方面：

（1）强化合规培训，培养合规文化。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，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

（2）加强制度建设，构建全面内部控制体系。公司根据法律法规等规范性文件，制定了较为完善的内部管理制度。本年度，根据新的监管要求和业务发展，公司对原有制度进行了及时修订，内容涵盖投资研究管理、债券交易管理、公平交易等方面。

（3）加强监察稽核工作，强化风险管理。公司重视监察稽核工作，不断提高和完善监察稽核工作的深度和广度，结合事前、事中和事后的风险控制，提高业务部门人员的风险意识水平，保障基金运作所涉及的各个环节按照法律法规和公司制度执行。

本报告期内，内控部门审核了公司制定（修订）的制度、合同协议、公募基金产品的宣传材料、信息披露文件、新股申购网下询价的关联关系核查及投资运作等相关事项。

本报告期内，基金运作合法合规，未发生重大风险事件。

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，本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形；截至报告期末，本基金资产净值仍低于五千万元。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、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 | CAC 证审字[2020]0259 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 | 国都多策略混合型证券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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 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 2019 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，披露与持续经营相关的事项，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</p> |

| | | |
|-----------------|--|-----|
| | 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 | 中审华会计师事务所（特殊普通合伙） | |
| 注册会计师的姓名 | 高宏伟 | 黄庆林 |
| 会计师事务所的地址 | 北京市西城区百万庄大街 22 号院 2 号楼 5 层 | |
| 审计报告日期 | 2020 年 3 月 25 日 | |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国都多策略混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资 产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 602,067.08 | 528,469.45 |
| 结算备付金 | | 24,898.53 | 591,158.03 |
| 存出保证金 | | 31,593.79 | 9,953.68 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 4,196,659.00 | 4,431,279.00 |
| 其中：股票投资 | | 4,196,659.00 | 4,431,279.00 |
| 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 | 600,015.00 | 9,000,185.00 |
| 应收证券清算款 | | 204,696.04 | 94,907.51 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 423.00 | 5,596.21 |
| 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 | | 5,660,352.44 | 14,661,548.88 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 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 | | - | 301.44 |
| 应付管理人报酬 | | 7,212.00 | 18,717.04 |
| 应付托管费 | | 721.21 | 1,871.73 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 6,521.98 | 1,670.55 |
| 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 | 30,000.00 | 90,000.04 |
| 负债合计 | | 44,455.19 | 112,560.80 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 4,122,785.99 | 14,922,165.47 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 1,493,111.26 | -373,177.39 |
| 所有者权益合计 | | 5,615,897.25 | 14,548,988.08 |
| 负债和所有者权益总计 | | 5,660,352.44 | 14,661,548.88 |

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3622 元，基金份额总额 4,122,785.99 份。

7.2 利润表

会计主体：国都多策略混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2018 年 5 月 25 日(基 金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|---|--|
| 一、收入 | | 4,598,986.00 | 1,489,826.75 |
| 1. 利息收入 | | 88,501.76 | 1,096,855.76 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 49,767.85 | 132,120.56 |
| 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 | | 38,733.91 | 964,735.20 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 3,478,257.11 | -311,838.91 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 3,389,179.11 | -317,265.78 |
| 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 | 89,078.00 | 5,426.87 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 718,254.50 | -325,547.20 |
| 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 | 313,972.63 | 1,030,357.10 |
| 减：二、费用 | | 426,477.42 | 704,879.68 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 163,686.05 | 514,362.44 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 16,368.60 | 51,436.20 |

| | | | |
|---------------------|------------|-----------------|--------------|
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 216, 222. 77 | 48, 576. 04 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | - | - |
| 7. 其他费用 | 7.4.7.20 | 30, 200. 00 | 90, 505. 00 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 4, 172, 508. 58 | 784, 947. 07 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 4, 172, 508. 58 | 784, 947. 07 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国都多策略混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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） | 14, 922, 165. 47 | -373, 177. 39 | 14, 548, 988. 08 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 4, 172, 508. 58 | 4, 172, 508. 58 |
| 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） | -10, 799, 379. 48 | -2, 306, 219. 93 | -13, 105, 599. 41 |
| 其中：1. 基金申购款 | 32, 938, 164. 59 | 7, 744, 280. 34 | 40, 682, 444. 93 |
| 2. 基金赎回款 | -43, 737, 544. 07 | -10, 050, 500. 27 | -53, 788, 044. 34 |
| 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） | 4, 122, 785. 99 | 1, 493, 111. 26 | 5, 615, 897. 25 |
| 项目 | 上年度可比期间 2018 年 5 月 25 日（基金合同生效日）至 2018 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） | 289,058,401.60 | - | 289,058,401.60 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 784,947.07 | 784,947.07 |
| 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） | -274,136,236.13 | -1,158,124.46 | -275,294,360.59 |
| 其中：1. 基金申购款 | 179,102.77 | 2,920.19 | 182,022.96 |
| 2. 基金赎回款 | -274,315,338.90 | -1,161,044.65 | -275,476,383.55 |
| 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） | 14,922,165.47 | -373,177.39 | 14,548,988.08 |

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：

| | | |
|------------|-----------|-----------|
| <u>赵远峰</u> | <u>封欣</u> | <u>陈蕾</u> |
| 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

国都多策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2017 年 9 月 22 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予国都多策略混合型证券投资基金注册的批复》证监许可〔2017〕1733 号文核准注册，自 2018 年 2 月 26 日至 2018 年 5 月 22 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 288,892,869.22 元人民币，并经中审华会计师事务所（特殊普通合伙）“CAC 证验字[2018]0036 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《国都多策略混合型证券投资基金合同》于 2018 年 5 月 25 日正式生效。

基金合同生效日的基金份额总额为 289,058,401.60 份基金单位，其中认购资金利息折合 165,532.38 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）、可交换债券等）、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》、《国都多策略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 2018 年度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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度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

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

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 2018 年 5 月 25 日（基金合同生效日）至 2018 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

其变动计入当期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卖出回购金融资产款和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

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资、贵金属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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的

公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

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 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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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) 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中债金融估值中心有限公司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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 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) 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) 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 602,067.08 | 528,469.45 |
| 定期存款 | — | — |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | — | — |
| 存款期限 1-3 个月 | — | — |
| 存款期限 3 个月以上 | — | — |
| 其他存款 | — | — |
| 合计： | 602,067.08 | 528,469.45 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | | |
|---------------|--------------------------|--------------|-------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 3,803,951.70 | 4,196,659.00 | 392,707.30 |
| 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 | 3,803,951.70 | 4,196,659.00 | 392,707.30 |
| 项目 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 | | |
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 4,756,826.20 | 4,431,279.00 | -325,547.20 |
| 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 | 4,756,826.20 | 4,431,279.00 | -325,547.20 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | |
|-------|--------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 600,015.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 600,015.00 | - |
| 项目 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 9,000,185.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 9,000,185.00 | - |

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 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息 | 362.56 | 553.56 |
| 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 | 12.32 | 292.60 |
| 应收债券利息 | - | - |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | 32.39 | 4,745.21 |
| 应收申购款利息 | - | - |

| | | |
|------------|--------|----------|
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 应收出借证券利息 | - | - |
| 其他 | 15.73 | 4.84 |
| 合计 | 423.00 | 5,596.21 |

注：1、“其他”为应收结算保证金利息。

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 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 6,521.98 | 1,670.55 |
| 银行间市场应付交易费用 | - | - |
| 合计 | 6,521.98 | 1,670.55 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | - | 0.04 |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 预提费用 | 30,000.00 | 90,000.00 |
| 合计 | 30,000.00 | 90,000.04 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 14,922,165.47 | 14,922,165.47 |
| 本期申购 | 32,938,164.59 | 32,938,164.59 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -43,737,544.07 | -43,737,544.07 |
| - 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 | 4,122,785.99 | 4,122,785.99 |
|-----|--------------|--------------|

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。

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 | -88,247.25 | -284,930.14 | -373,177.39 |
| 本期利润 | 3,454,254.08 | 718,254.50 | 4,172,508.58 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,812,160.75 | -494,059.18 | -2,306,219.93 |
| 其中：基金申购款 | 4,971,206.77 | 2,773,073.57 | 7,744,280.34 |
| 基金赎回款 | -6,783,367.52 | -3,267,132.75 | -10,050,500.27 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,553,846.08 | -60,734.82 | 1,493,111.26 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年12月 31日 | 上年度可比期间 2018年5月25日(基金合同生效日) 至2018年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|--|
| 活期存款利息收入 | 46,787.91 | 119,937.53 |
| 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 | 2,586.42 | 12,139.52 |
| 其他 | 393.52 | 43.51 |
| 合计 | 49,767.85 | 132,120.56 |

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 2019年1月1日至2019 年12月31日 | 上年度可比期间 2018年5月25日(基金 合同生效日)至2018年12月 31日 |
|------------|---------------------------------|--|
| 卖出股票成交总额 | 73,520,782.60 | 14,500,259.86 |
| 减：卖出股票成本总额 | 70,131,603.49 | 14,817,525.64 |

| | | |
|----------|--------------|-------------|
| 买卖股票差价收入 | 3,389,179.11 | -317,265.78 |
|----------|--------------|-------------|

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：本基金本报告期无债券投资收益—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：本基金本报告期无贵金属投资收益—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投资收益—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投资收益—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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2018 年 5 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日 |
|---------------|--|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 89,078.00 | 5,426.87 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 89,078.00 | 5,426.87 |

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2018 年 5 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日 |
|------------------------|--|---|
| 1. 交易性金融资产 | 718,254.50 | -325,547.20 |
| ——股票投资 | 718,254.50 | -325,547.20 |
| ——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 | - | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - | - |
| 合计 | 718,254.50 | -325,547.20 |

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2018 年 5 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日 |
|---------|--|---|
| 基金赎回费收入 | 312,305.63 | 1,030,357.10 |
| 其他 | 1,667.00 | - |
| 合计 | 313,972.63 | 1,030,357.10 |

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2018 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|-----------|--|---|
| 交易所市场交易费用 | 216,222.77 | 48,576.04 |
| 银行间市场交易费用 | - | - |
| 交易基金产生的费用 | - | - |
| 其中：申购费 | - | - |
| 赎回费 | - | - |
| 合计 | 216,222.77 | 48,576.04 |

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2018 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---------|--|---|
| 审计费用 | 30,000.00 | 30,000.00 |
| 信息披露费 | - | 60,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行划款手续费 | 200.00 | 105.00 |
| 证券账户开户费 | - | 400.00 |
| 合计 | 30,200.00 | 90,505.00 |

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。

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2018 年 5 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2018 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 | 142,699,511.59 | 100.00% | 34,074,611.70 | 100.00% |

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期末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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2018 年 5 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2018 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 | 123,600,000.00 | 100.00% | 1,924,800,000.00 | 100.00% |
|------------|----------------|---------|------------------|---------|

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 2019年1月1日至2019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 | 131,638.55 | 100.00% | 6,521.98 | 100.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2018年5月25日(基金合同生效日)至2018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 | 64,755.07 | 100.00% | 1,670.55 | 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 2019年1月1日至2019年12月31日 | 上年度可比期间 2018年5月25日(基金合同生效日)至2018年12月31日 |
|-----------------|-----------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 163,686.05 | 514,362.44 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 43,063.04 | 81,528.96 |

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。由基金管理人授权基金托管人于次月首日起 5 个工作日内将双方复核后的管理费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、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

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 |
|----------------|----------------------------------|--|
| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 2018 年 5 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 16,368.60 | 51,436.20 |

注：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。由基金管理人授权基金托管人于次月首日起 5 个工作日内将双方复核后的托管费从基金资产中一次性支取。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：本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金其他关联方在本报告期末未持有本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方 名称 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|-----------|----------------------------------|-----------|--|------------|
| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | | 2018 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2018 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 | 602,067.08 | 46,787.91 | 528,469.45 | 119,937.53 |

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。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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（2019 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

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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，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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

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和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：本基金本期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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

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、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 80%以上，可流通股票资产变现天数低于 1 天，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 2019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 | 602,067.08 | - | - | - | - | - | 602,067.08 |
| 结算备付金 | 24,898.53 | - | - | - | - | - | 24,898.53 |
| 存出保证金 | 31,593.79 | - | - | - | - | - | 31,593.79 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 4,196,659.00 | 4,196,659.00 |
| 买入返售金融资产 | 600,000.00 | - | - | - | - | - | 600,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 204,696.04 | 204,696.04 |

| | | | | | | | |
|--------------------------|---------------|--------|----------|-------|-------|---------------|---------------|
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 423.00 | 423.00 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | 15.00 | 15.00 |
| 资产总计 | 1,258,559.40 | - | - | - | - | -4,401,793.04 | 5,660,352.44 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 7,212.00 | 7,212.00 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 721.21 | 721.21 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 6,521.98 | 6,521.98 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 30,000.00 | 30,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 44,455.19 | 44,455.19 |
| 利率敏感度缺口 | 1,258,559.40 | - | - | - | - | -4,357,337.85 | 5,615,897.25 |
| 上年度末 2018 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 | 528,469.45 | - | - | - | - | - | 528,469.45 |
| 结算备付金 | 591,158.03 | - | - | - | - | - | 591,158.03 |
| 存出保证金 | 9,953.68 | - | - | - | - | - | 9,953.68 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | -4,431,279.00 | 4,431,279.00 |
| 买入返售金融资产 | 9,000,000.00 | - | - | - | - | - | 9,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 94,907.51 | 94,907.51 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 5,596.21 | 5,596.21 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | 185.00 | 185.00 |
| 资产总计 | 10,129,581.16 | - | - | - | - | -4,531,967.72 | 14,661,548.88 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 301.44 | 301.44 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 18,717.04 | 18,717.04 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 1,871.73 | 1,871.73 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 1,670.55 | 1,670.55 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 90,000.04 | 90,000.04 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 112,560.80 | 112,560.80 |
| 利率敏感度缺口 | 10,129,581.16 | - | - | - | - | -4,419,406.92 | 14,548,988.08 |

注：1、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

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 2019 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2018 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 | 4,196,659.00 | 74.73 | 4,431,279.00 | 30.46 |
| 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 | 4,196,659.00 | 74.73 | 4,431,279.00 | 30.46 |

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（2019 年 12 月 31 日） | 上年度末（2018 年 12 月 31 日） |
| | 沪深 300 指数下跌 5% | -153,015.71 | -237,841.31 |
| | 沪深 300 指数上涨 5% | 153,015.71 | 237,841.31 |

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 189,069.86 元，占基金资产净值比例为 2.34%。

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 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中属于第一层次的余额为 4,196,659.00 元，无属于第二层次、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 2019 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 | 4,196,659.00 | 74.14 |
| | 其中：股票 | 4,196,659.00 | 74.14 |
| 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 | 600,015.00 | 10.60 |
| | 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 | 626,965.61 | 11.08 |
| 8 | 其他各项资产 | 236,712.83 | 4.18 |
| 9 | 合计 | 5,660,352.44 | 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 | 3,029,584.00 | 53.95 |
| 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 | — | — |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | — | — |
| H | 住宿和餐饮业 | 446,445.00 | 7.95 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | — | — |
| J | 金融业 | 405,780.00 | 7.23 |
| K | 房地产业 | — | — |
| L | 租赁和商务服务业 | 187,800.00 | 3.34 |
| 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 | 127,050.00 | 2.26 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 4,196,659.00 | 74.73 |

注：以上行业分类以 2019 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 | 600585 | 海螺水泥 | 8,000 | 438,400.00 | 7.81 |
| 2 | 600529 | 山东药玻 | 15,000 | 414,600.00 | 7.38 |
| 3 | 603517 | 绝味食品 | 8,500 | 394,825.00 | 7.03 |
| 4 | 600258 | 首旅酒店 | 14,000 | 288,540.00 | 5.14 |
| 5 | 000651 | 格力电器 | 4,000 | 262,320.00 | 4.67 |
| 6 | 603027 | 千禾味业 | 12,000 | 255,120.00 | 4.54 |
| 7 | 000951 | 中国重汽 | 10,000 | 225,000.00 | 4.01 |
| 8 | 000425 | 徐工机械 | 40,000 | 218,800.00 | 3.90 |
| 9 | 000166 | 申万宏源 | 40,000 | 204,800.00 | 3.65 |
| 10 | 600837 | 海通证券 | 13,000 | 200,980.00 | 3.58 |
| 11 | 002027 | 分众传媒 | 30,000 | 187,800.00 | 3.34 |
| 12 | 600809 | 山西汾酒 | 2,000 | 179,400.00 | 3.19 |
| 13 | 002568 | 百润股份 | 6,500 | 170,755.00 | 3.04 |
| 14 | 600754 | 锦江酒店 | 5,500 | 157,905.00 | 2.81 |
| 15 | 000661 | 长春高新 | 300 | 134,100.00 | 2.39 |
| 16 | 002739 | 万达电影 | 7,000 | 127,050.00 | 2.26 |
| 17 | 002035 | 华帝股份 | 6,000 | 80,520.00 | 1.43 |
| 18 | 002240 | 威华股份 | 10,000 | 79,500.00 | 1.42 |
| 19 | 603308 | 应流股份 | 4,400 | 66,044.00 | 1.18 |
| 20 | 002100 | 天康生物 | 5,000 | 63,900.00 | 1.14 |
| 21 | 002384 | 东山精密 | 2,000 | 46,300.00 | 0.82 |

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 | 601318 | 中国平安 | 4,994,594.00 | 34.33 |
| 2 | 600585 | 海螺水泥 | 4,833,772.00 | 33.22 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 4,608,445.00 | 31.68 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 4,530,397.00 | 31.14 |
| 5 | 601888 | 中国国旅 | 4,471,197.16 | 30.73 |
| 6 | 600009 | 上海机场 | 3,909,657.54 | 26.87 |
| 7 | 300498 | 温氏股份 | 2,453,854.68 | 16.87 |
| 8 | 002100 | 天康生物 | 1,869,766.00 | 12.85 |
| 9 | 600837 | 海通证券 | 1,687,841.00 | 11.60 |
| 10 | 603027 | 千禾味业 | 1,680,137.00 | 11.55 |
| 11 | 002714 | 牧原股份 | 1,666,314.00 | 11.45 |
| 12 | 000876 | 新希望 | 1,628,280.00 | 11.19 |
| 13 | 600809 | 山西汾酒 | 1,609,530.65 | 11.06 |
| 14 | 002299 | 圣农发展 | 1,564,024.00 | 10.75 |
| 15 | 000858 | 五粮液 | 1,540,795.00 | 10.59 |
| 16 | 002746 | 仙坛股份 | 1,265,195.00 | 8.70 |
| 17 | 603363 | 傲农生物 | 1,231,721.00 | 8.47 |
| 18 | 601788 | 光大证券 | 1,131,869.00 | 7.78 |
| 19 | 600872 | 中炬高新 | 1,123,415.00 | 7.72 |
| 20 | 000951 | 中国重汽 | 1,042,342.40 | 7.16 |
| 21 | 603288 | 海天味业 | 965,622.00 | 6.64 |
| 22 | 601009 | 南京银行 | 947,972.00 | 6.52 |
| 23 | 601818 | 光大银行 | 872,140.00 | 5.99 |
| 24 | 000402 | 金融街 | 860,880.00 | 5.92 |
| 25 | 002027 | 分众传媒 | 839,450.00 | 5.77 |
| 26 | 600258 | 首旅酒店 | 829,709.00 | 5.70 |
| 27 | 603259 | 药明康德 | 802,100.00 | 5.51 |
| 28 | 002035 | 华帝股份 | 780,781.00 | 5.37 |
| 29 | 300115 | 长盈精密 | 744,550.00 | 5.12 |
| 30 | 002321 | 华英农业 | 698,240.00 | 4.80 |
| 31 | 601336 | 新华保险 | 659,833.00 | 4.54 |

| | | | | |
|----|--------|-------|------------|------|
| 32 | 002304 | 洋河股份 | 628,449.00 | 4.32 |
| 33 | 000568 | 泸州老窖 | 601,758.00 | 4.14 |
| 34 | 002458 | 益生股份 | 534,796.00 | 3.68 |
| 35 | 000651 | 格力电器 | 529,249.00 | 3.64 |
| 36 | 603517 | 绝味食品 | 462,237.00 | 3.18 |
| 37 | 600771 | 广誉远 | 449,648.00 | 3.09 |
| 38 | 601988 | 中国银行 | 437,000.00 | 3.00 |
| 39 | 002241 | 歌尔股份 | 395,200.00 | 2.72 |
| 40 | 600529 | 山东药玻 | 389,559.00 | 2.68 |
| 41 | 000069 | 华侨城 A | 359,500.00 | 2.47 |
| 42 | 600426 | 华鲁恒升 | 297,000.00 | 2.04 |
| 43 | 300357 | 我武生物 | 291,970.00 | 2.01 |

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 4,970,029.00 | 34.16 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 4,642,960.04 | 31.91 |
| 3 | 601888 | 中国国旅 | 4,637,070.72 | 31.87 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 4,631,545.00 | 31.83 |
| 5 | 600585 | 海螺水泥 | 4,501,670.00 | 30.94 |
| 6 | 600009 | 上海机场 | 3,824,960.41 | 26.29 |
| 7 | 300498 | 温氏股份 | 2,578,559.00 | 17.72 |
| 8 | 000876 | 新希望 | 2,011,328.60 | 13.82 |
| 9 | 002100 | 天康生物 | 1,964,302.00 | 13.50 |
| 10 | 600872 | 中炬高新 | 1,891,853.00 | 13.00 |
| 11 | 002714 | 牧原股份 | 1,875,705.00 | 12.89 |
| 12 | 603027 | 千禾味业 | 1,822,806.60 | 12.53 |
| 13 | 000858 | 五粮液 | 1,787,049.00 | 12.28 |
| 14 | 002299 | 圣农发展 | 1,727,795.58 | 11.88 |
| 15 | 600809 | 山西汾酒 | 1,614,323.00 | 11.10 |
| 16 | 601009 | 南京银行 | 1,544,228.00 | 10.61 |
| 17 | 600837 | 海通证券 | 1,532,422.80 | 10.53 |
| 18 | 601818 | 光大银行 | 1,503,871.00 | 10.34 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 19 | 002746 | 仙坛股份 | 1,430,724.00 | 9.83 |
| 20 | 603363 | 傲农生物 | 1,325,800.00 | 9.11 |
| 21 | 603517 | 绝味食品 | 1,151,742.00 | 7.92 |
| 22 | 601788 | 光大证券 | 1,081,600.00 | 7.43 |
| 23 | 603288 | 海天味业 | 1,023,876.00 | 7.04 |
| 24 | 300115 | 长盈精密 | 899,441.00 | 6.18 |
| 25 | 000951 | 中国重汽 | 874,106.00 | 6.01 |
| 26 | 000402 | 金融街 | 853,468.50 | 5.87 |
| 27 | 603259 | 药明康德 | 847,455.00 | 5.82 |
| 28 | 002027 | 分众传媒 | 818,314.00 | 5.62 |
| 29 | 002035 | 华帝股份 | 768,608.50 | 5.28 |
| 30 | 601288 | 农业银行 | 758,700.00 | 5.21 |
| 31 | 002321 | 华英农业 | 723,647.00 | 4.97 |
| 32 | 601336 | 新华保险 | 680,072.00 | 4.67 |
| 33 | 002304 | 洋河股份 | 652,154.00 | 4.48 |
| 34 | 000568 | 泸州老窖 | 637,221.05 | 4.38 |
| 35 | 600900 | 长江电力 | 603,365.00 | 4.15 |
| 36 | 600258 | 首旅酒店 | 592,036.00 | 4.07 |
| 37 | 300630 | 普利制药 | 545,036.00 | 3.75 |
| 38 | 601988 | 中国银行 | 440,700.00 | 3.03 |
| 39 | 002241 | 歌尔股份 | 398,000.00 | 2.74 |
| 40 | 600771 | 广誉远 | 382,333.00 | 2.63 |
| 41 | 002458 | 益生股份 | 363,622.00 | 2.50 |
| 42 | 000069 | 华侨城 A | 344,500.00 | 2.37 |
| 43 | 300212 | 易华录 | 334,534.00 | 2.30 |
| 44 | 603019 | 中科曙光 | 303,274.80 | 2.08 |
| 45 | 600426 | 华鲁恒升 | 296,582.00 | 2.04 |
| 46 | 300357 | 我武生物 | 295,494.00 | 2.03 |

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 | 69,178,728.99 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 73,520,782.60 |

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：（1）本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金本报告期内未进行股指期货交易。

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：（1）本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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 | 31,593.79 |
| 2 | 应收证券清算款 | 204,696.04 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 423.00 |
| 5 | 应收申购款 | — |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 236,712.83 |

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。

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的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§ 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 |
| 241 | 17,107.00 | 0.00 | 0.00% | 4,122,785.99 | 100.00% |

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 | 99,312.80 | 2.4089% |

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 | 0-10 |

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（ 2018 年 5 月 25 日 ）基金份额总额 | 289,058,401.60 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 14,922,165.47 |
| 本报告期基金总申购份额 | 32,938,164.59 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 43,737,544.07 |
| 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 | 4,122,785.99 |

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

本报告期内，无涉及基金管理人基金管理业务的专门基金托管部门的重大人事变动。

自 2019 年 1 月 22 日起，叶文煌先生担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，吴若曼女士不再担任基金托管人资产托管部总经理。

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未决诉讼、仲裁案件（主要涉及私募资产管理业务的债券违约纠纷、股票质押式回购交易违约纠纷、劳动争议等）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审华会计师事务所(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，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 | 2 | 142,699,511.59 | 100.00% | 131,638.55 | 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、本基金本报告期内无新增和剔除席位，与托管在同一托管行的公司其他基金公用交易单元。

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 | — | — | 123,600,000.00 | 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 | 2019-05-31 至 2019-06-17, 2019-06-20 至 2019-06-20 | 0.00 | 8,043,262.74 | 8,043,262.74 | 0.00 | 0.00% |
| | 2 | 2019-05-31 至 2019-06-03 | 0.00 | 6,928,687.16 | 6,928,687.16 | 0.00 | 0.00% |
| | 3 | 2019-06-04 至 2019-06-18 | 0.00 | 8,083,265.97 | 8,083,265.97 | 0.00 | 0.00% |
| | 4 | 2019-06-04 至 2019-06-19 | 0.00 | 8,083,265.97 | 8,083,265.97 | 0.00 | 0.00% |
| | 5 | 2019-06-20 至 2019-06-20 | 0.00 | 8,043,262.74 | 8,043,262.74 | 0.00 | 0.00% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| - | | | | | | | |

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《国都多策略混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 2、《国都多策略混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《国都多策略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

2020 年 4 月 30 日