

国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

度基金份额净值增长率-11.72%，同期基金份额净值增长率-9.45%，本基金份额净值增长率低于业绩比较基准2.27个百分点。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金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，本基金资产净值的低五千万元。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	22,085,185.00	76.51
其中:股票	22,085,185.00	76.51	
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-	
4	金融衍生品	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	7,128,366.94	24.37
8	其他资产	36,460.92	0.12
9	合计	29,249,952.86	100.00

注:以上行业分类以2018年12月31日的证监会行业分类标准为依据。

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注:本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.1.1.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002470	汉鼎股份	221,000	1,386,720.00	4.82
2	601688	华泰证券	80,000	1,286,000.00	4.47
3	002415	海康威视	50,000	1,288,000.00	4.46
4	600269	安泰江苏	110,000	1,262,300.00	4.36
5	002236	大华股份	110,000	1,260,600.00	4.28
6	600419	天狮药业	90,000	1,238,400.00	4.27
7	600030	中信证券	70,000	1,120,700.00	3.87
8	600269	安泰江苏	70,000	928,000.00	3.24
9	600271	航天信息	40,000	975,600.00	3.16
10	601336	新华保险	20,000	844,800.00	2.92

注:本基金所投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.4 报告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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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,并规避相对收益。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有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。

5.1.2 其他资产构成

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	22,085,185.00	76.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-	
4	金融衍生品	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	7,128,366.94	24.37
8	其他资产	36,460.92	0.12
9	合计	29,249,952.86	100.00

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,813,316.00	44.23
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	1,870,000.00	6.30
G	交通运输、仓储和邮政业	2,947,400.00	10.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,819,580.00	6.28
J	金融业	4,651,700.00	16.06
K	房地产业	-	-
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	交通运输、仓储和邮政业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	683,200.00	2.36
S	综合	-	-
合计		22,085,185.00	76.52

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.5 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.5.1 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。

5.5.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有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。

5.1.2 其他资产构成

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	22,085,185.00	76.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-	
4	金融衍生品	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	7,128,366.94	24.37
8	其他资产	36,460.92	0.12
9	合计	29,249,952.86	100.00

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,813,316.00	44.23
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	1,870,000.00	6.30
G	交通运输、仓储和邮政业	2,947,400.00	10.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,819,580.00	6.28
J	金融业	4,651,700.00	16.06
K	房地产业	-	-
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	交通运输、仓储和邮政业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	683,200.00	2.36
S	综合	-	-
合计		22,085,185.00	76.52

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.5 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.5.1 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。

5.5.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有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。

5.1.2 其他资产构成

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	22,085,185.00	76.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-	
4	金融衍生品	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	7,128,366.94	24.37
8	其他资产	36,460.92	0.12
9	合计	29,249,952.86	100.00

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,813,316.00	44.23
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	1,870,000.00	6.30
G	交通运输、仓储和邮政业	2,947,400.00	10.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,819,580.00	6.28
J	金融业	4,651,700.00	16.06
K	房地产业	-	-
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	交通运输、仓储和邮政业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	683,200.00	2.36
S	综合	-	-
合计		22,085,185.00	76.52

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.5 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.5.1 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。

5.5.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有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。

5.1.2 其他资产构成

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	22,085,185.00	76.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-	
4	金融衍生品	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	7,128,366.94	24.37
8	其他资产	36,460.92	0.12
9	合计	29,249,952.86	100.00

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,813,316.00	44.23
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	1,870,000.00	6.30
G	交通运输、仓储和邮政业	2,947,400.00	10.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,819,580.00	6.28
J	金融业	4,651,700.00	16.06
K	房地产业	-	-
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	交通运输、仓储和邮政业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	683,200.00	2.36
S	综合	-	-
合计		22,085,185.00	76.52

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.5 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.5.1 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。

5.5.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有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。

5.1.2 其他资产构成

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	22,085,185.00	76.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-	
4	金融衍生品	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	7,128,366.94	24.37
8	其他资产	36,460.92	0.12
9	合计	29,249,952.86	100.00

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,813,316.00	44.23
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	1,870,000.00	6.30
G	交通运输、仓储和邮政业	2,947,400.00	10.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,819,580.00	6.28
J	金融业	4,651,700.00	16.06
K	房地产业	-	-
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	交通运输、仓储和邮政业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	683,200.00	2.36
S	综合	-	-
合计		22,085,185.00	76.52

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.5 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.5.1 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。

5.5.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有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。

5.1.2 其他资产构成

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	22,085,185.00	76.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-	
4	金融衍生品	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	7,128,366.94	24.37
8	其他资产	36,460.92	