

国都多策略混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

融等行业,尤其在食品饮料等传统行业上面配置了较多的仓位,取得了较好的绝对收益。在具体标的选择方面,本基金综合考虑利率增速、盈利模式和市场环境等因素,重点配置相关行业的龙头公司,或其他安全边际较高的公司。

本基金认为,传统行业的很多龙头公司已经形成了强大的品牌力、规模优势和成本优势,竞争优势可以长期保持,这些公司仍然是本基金重点投资的长线标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截止2019年3月31日,本基金份额净值为1.2126元,份额累计净值1.2126元,一季度基金份额净值增长率为24.37%,同期基金业绩比较基准增长率16.65%,本基金份额净值增长率高于业绩比较基准7.79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。

5.1 投资组合报告
5.1.1 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	7,128,730.00	69.84
2	其中:股票	7,128,730.00	69.84
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	1,000,100.00	9.66
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	2,199,060.41	21.24
11	其他资产	27,148.08	0.26
12	合计	10,356,038.39	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 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	1,008,395.00	10.09
B	采矿业	28,110.00	0.28
C	制造业	4,215,765.00	42.17
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	87,020.00	0.86
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,452.00	0.39
J	金融业	1,228,790.00	12.28
K	房地产业	550,470.00	5.51
L	租赁和商务服务业	627.00	0.01
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	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		7,128,730.00	71.31

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。

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

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	603517	德棉食品	18,000	885,960.00	8.86
2	600872	中炬高新	24,000	877,920.00	8.78
3	603927	千禾食品	25,000	604,250.00	6.04
4	300030	普联软件	7,000	529,330.00	5.27
5	300498	福妃股份	12,500	507,500.00	5.08
6	002259	圣农发展	20,000	497,800.00	4.96
7	600827	鲁商股份	25,000	481,050.00	4.81
8	000776	新希望	35,000	465,550.00	4.65
9	002100	天康生物	50,000	453,500.00	4.54
10	601000	浦发银行	56,000	436,000.00	4.36

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:(1)本基金本报告期末未持有股指期货交易。
(2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易,以降低股指期货仓位调整的交易成本,提高投资效率,从而更好地实现投资目标。

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:(1)本基金本报告期末未持有国债期货。
(2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

5.10.3 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。

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过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。

5.11.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选证券库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	41,507.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,887.28
5	应收申购款	1,401.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,885.63

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

5.11.7 开放式基金资产变动

报告期初基金份额总额	报告期间基金总申购份额	报告期间基金总赎回份额	报告期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	报告期末基金份额总额
62,960,004.02	9,042.34	4,245,903.09	-	58,663,138.84

注:总申购份额含转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
注:本报告期内,基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注:本报告期内,本公司未运用固有资金申购、赎回本基金。

8 影响投资者决策的其他重要信息
无。

9 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

9.2 存放地点
基金管理人和本基金托管人的住所,并载于基金管理人网站www.guodu.com

9.3 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印件或复印件。相比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
2019年4月22日

国都多策略混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

融等行业,尤其在食品饮料等传统行业上面配置了较多的仓位,取得了较好的绝对收益。在具体标的选择方面,本基金综合考虑利率增速、盈利模式和市场环境等因素,重点配置相关行业的龙头公司,或其他安全边际较高的公司。

本基金认为,传统行业的很多龙头公司已经形成了强大的品牌力、规模优势和成本优势,竞争优势可以长期保持,这些公司仍然是本基金重点投资的长线标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截止2019年3月31日,本基金份额净值为1.2126元,份额累计净值1.2126元,一季度基金份额净值增长率为24.37%,同期基金业绩比较基准增长率16.65%,本基金份额净值增长率高于业绩比较基准7.79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。

5.1 投资组合报告
5.1.1 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	7,128,730.00	69.84
2	其中:股票	7,128,730.00	69.84
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	1,000,100.00	9.66
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	2,199,060.41	21.24
11	其他资产	27,148.08	0.26
12	合计	10,356,038.39	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 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	1,008,395.00	10.09
B	采矿业	28,110.00	0.28
C	制造业	4,215,765.00	42.17
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	87,020.00	0.86
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,452.00	0.39
J	金融业	1,228,790.00	12.28
K	房地产业	550,470.00	5.51
L	租赁和商务服务业	627.00	0.01
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	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		7,128,730.00	71.31

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。

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

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	603517	德棉食品	18,000	885,960.00	8.86
2	600872	中炬高新	24,000	877,920.00	8.78
3	603927	千禾食品	25,000	604,250.00	6.04
4	300030	普联软件	7,000	529,330.00	5.27
5	300498	福妃股份	12,500	507,500.00	5.08
6	002259	圣农发展	20,000	497,800.00	4.96
7	600827	鲁商股份	25,000	481,050.00	4.81
8	000776	新希望	35,000	465,550.00	4.65
9	002100	天康生物	50,000	453,500.00	4.54
10	601000	浦发银行	56,000	436,000.00	4.36

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:(1)本基金本报告期末未持有股指期货交易。
(2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易,以降低股指期货仓位调整的交易成本,提高投资效率,从而更好地实现投资目标。

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:(1)本基金本报告期末未持有国债期货。
(2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

5.10.3 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。

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过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。

5.11.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选证券库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	40,421.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,576.15
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	56,997.27

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

5.11.7 开放式基金资产变动

报告期初基金份额总额	报告期间基金总申购份额	报告期间基金总赎回份额	报告期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	报告期末基金份额总额
62,960,004.02	9,042.34	4,245,903.09	-	58,663,138.84

注:总申购份额含转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
注:本报告期内,基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注:本报告期内,本公司未运用固有资金申购、赎回本基金。

8 影响投资者决策的其他重要信息
无。

9 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

9.2 存放地点
基金管理人和本基金托管人的住所,并载于基金管理人网站www.guodu.com

9.3 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印件或复印件。相比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
2019年4月22日

国都量化精选混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

中长期投资机会,努力做好市场研究和投资工作,为投资者带来超额回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截止2019年3月31日,本基金份额净值为0.8786元,份额累计净值0.8786元,季度基金份额净值增长率为13.34%,同期基金业绩比较基准16.59%,本基金份额净值增长率低于业绩比较基准3.25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,本基金不存在连续二十个工作日出现基金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。

5.1 投资组合报告
5.1.1 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	36,127,292.00	65.22
2	其中:股票	36,127,292.00	65.22
3	固定收益投资	-	