国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告

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
报告送出日期:2020年1月17日

§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。

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1月16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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国都创新驱动
场内简称	-
交易代码	002020
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	2015年12月28日
报告期末基金份额总额	21,998,522.16份
投资目标	在有效控制风险、保持良好流动性的前提下,积极主动管理,追求基金的长期稳健增值
投资策略	本基金以宏观分析为基础,结合各行业的演绎特征,确定阶段性重点行业,由行业研究团队加以重点覆盖,行业研究员重点对所覆盖的行业及个股的成长性及估值水平做出独立的判断和评级,精选优质个股作为构建组合的基础。一方面,基金管理人通过研究中国经济新常态下各行业在新形势下的转型和升级,结合宏观经济政策和导向,寻找中国当期阶段最受益的核心重点行业;另一方面,研究团队会对重点行业跟踪竞争格局的变化,把握产业演进和升级过程中,行业龙头盈利能力提升的投资机会
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*80%+中国债券总指数收益率*20%
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
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年10月1日 - 2019年12月31日)
1.本期已实现收益	1,699,287.66
2.本期利润	4,797,008.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.1967
4.期末基金资产净值	28,178,934.78
5.期末基金份额净值	1.281

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。

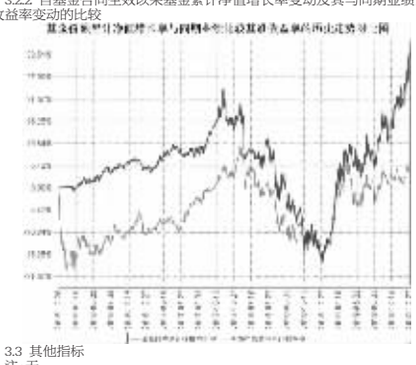
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	18.39%	1.11%	6.08%	0.59%	12.31%	0.52%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



3.3 其他指标

注:无

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
游典宗	基金经理	2015年12月28日	-	8年	经济学硕士。2011年加入国都证券,历任资产管理总部行业研究员、投资经理助理。现任国都证券基金管理部总经理助理、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《国都创新驱动灵活配置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 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年第四季度,市场上涨趋势明显,上证综指涨幅4.99%,中小板指涨幅10.59%,创业板指数涨幅10.48%。整体看来,创业板指数涨幅明显领先上证综指。

本基金一直聚焦于消费、医药、科技三个行业,秉持买入低估的好生意的投资理念,获取估值修复、业绩修复的双重获益。我们在四季度集中布局了光伏、新能源汽车、传媒等板块,这些持仓为我们带来了较好的收益。展望未来,我们认为目前的持仓结构的风险收益比是比较合适的,我们会保持目前的持仓水平和持仓结构,做好公司基本面的跟踪,为投资人的信任贡献回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止2019年12月31日,本基金份额净值为1.281元,份额累计净值1.321元,季度基金份额净值增长率18.39%。同期基金业绩比较基准6.08%,本基金份额净值增长率高于业绩比较基准12.31个百分点。

4.6 报告期内基金持有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 投资组合报告

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	26,006,995.16	91.17
	其中:股票	26,006,995.16	91.17
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	-	-
	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	2,333,320.96	8.18
8	其他资产	184,421.07	0.65
9	合计	28,524,737.19	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、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	17,422,701.20	61.83
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,337,000.00	18.94
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,781,000.00	6.32
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	4,040.96	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,253.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	1,452,000.00	5.15
S	综合	-	-
	合计	26,006,995.16	92.29

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。

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

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	002460	赣锋锂业	60,000	2,089,800.00	7.42
2	300136	信维通信	45,000	2,042,100.00	7.25
3	601865	福莱特	157,619	1,911,918.47	6.78
4	002555	三七互娱	70,000	1,885,100.00	6.69
5	002624	完美世界	40,000	1,765,600.00	6.27
6	601012	隆基股份	68,000	1,688,440.00	5.99
7	300274	阳光电源	150,000	1,579,500.00	5.61
8	000656	金科股份	190,000	1,459,200.00	5.18
9	002739	万达电影	80,000	1,452,000.00	5.15
10	600885	宏发股份	40,000	1,378,000.00	4.89

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。

(2)本基金本报告期内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。

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)本基金本报告期内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本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

5.11.2 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	存出保证金	21,980.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,085.35
5	应收申购款	161,355.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	184,421.07

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。

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	26,612,133.32
报告期期间基金总申购份额	1,265,770.58
减:报告期期间基金总赎回份额	5,879,381.74
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	21,998,522.16

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§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,本公司未持有本基金。

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

8.1 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

注:本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新

2、《国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其更新

3、《国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及其更新

4、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所,并登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1月17日

国都多策略混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告

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
报告送出日期:2020年1月17日

§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。

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1月16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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国都多策略
场内简称	-
交易代码	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
报告期末基金份额总额	4,122,785.99份
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年10月1日 - 2019年12月31日)
1.本期已实现收益	397,309.82
2.本期利润	304,445.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.0638
4.期末基金资产净值	5,615,897.25
5.期末基金份额净值	1.3622

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、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 本报告期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	净值增长率①	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%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

3.3 其他指标

注:无

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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。

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 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年四季度,本基金继续采取积极的投资策略,股票仓位一直维持在接近75%的水平,净值创出成立以来的新高。

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年持续向上。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。

在行业选择方面,本基金长期看好大众消费、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。

4.5 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,三季度基金份额净值增长率3.96%。同期基金业绩比较基准增长率4.77%,本基金份额净值增长率低于业绩比较基准0.81个百分点。

4.6 报告期内基金持有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 投资组合报告

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	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。

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。

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

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	601318	中国平安	119,900	10,246,654.00	7.98
2	600519	贵州茅台	5,400	6,388,200.00	4.97
3	600036	招商银行	135,700	5,099,606.00	3.97
4	601658	邮储银行	796,578	4,556,426.16	3.55
5	600276	恒瑞医药	35,000	3,063,200.00	2.38
6	600000	浦发银行	214,100	2,648,417.00	2.06
7	600030	中信证券	86,100	2,178,330.00	1.70
8	600887	伊利股份	67,500	2,088,450.00	1.63
9	688009	中国通号	276,430	1,874,195.40	1.46
10	600016	民生银行	276,400	1,744,084.00	1.36

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。

(2)本基金本报告期内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,以降低股票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股指期货。

(2)本基金本报告期内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本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

5.11.2 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

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。

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	5,823,318.77
报告期期间基金总申购份额	151,881.93
减:报告期期间基金总赎回份额	1,852,414.71
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以"-"填列)	-
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。

§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,本公司未持有本基金。

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

8.1 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

注:本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 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

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1月17日

国都量化精选混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告

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
报告送出日期:2020年1月17日

§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。

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1月16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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国都量化精选
场内简称	-
交易代码	005247
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	2017年12月27日
报告期末基金份额总额	137,787,023.22份
投资目标	利用量化投资策略和量化工具,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的持续稳健增值
投资策略	本基金通过量化策略和工具,对宏观政策、微观行业、市场情绪等方面进行全面研究,再辅以量化系统风险判定模型来确定中短期市场系统风险,通过风险判定模型来调整仓位,合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例,并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化,动态地调整投资比例,以达到控制下行风险的目标
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年10月1日 - 2019年12月31日)
1.本期已实现收益	3,610,740.22
2.本期利润	7,323,747.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0523
4.期末基金资产净值	128,439,651.78
5.期末基金份额净值	0.9322

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。

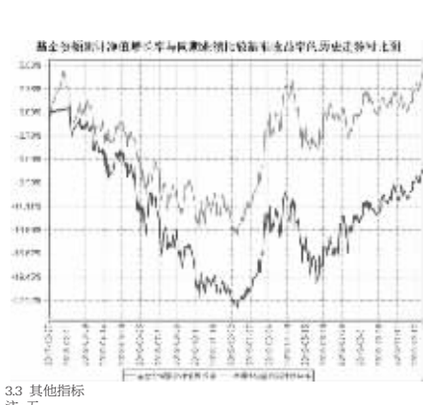
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	5.93%	0.49%	4.77%	0.44%	1.16%	0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



3.3 其他指标

注:无

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
游典宗	基金经理	2019年7月23日	-	8年	经济学硕士。2011年加入国都证券,历任资产管理总部行业研究员、投资经理助理。现任国都证券基金管理部总经理助理、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《国都量化精选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 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年第四季度,市场上涨趋势明显,上证综指涨幅4.99%,中小板指涨幅10.59%,创业板指数涨幅10.48%。整体看来,创业板指数涨幅明显领先上证综指。

报告期内,本基金在年初采用稳健运作思路,投资策略采用跟踪基准的指数增强策略,四季度获得了较好的投资回报,后续我们将加强改善量化模型对市场走势的判断能力和投资策略的灵活调整应对,努力给投资者带来满意的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止2019年12月31日,本基金份额净值为0.9322元,份额累计净值0.9322元,单季度基金份额净值增长率5.93%,同期基金业绩比较基准4.77%,本基金份额净值增长率高于业绩比较基准1.16个百分点。

4.6 报告期内基金持有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 投资组合报告

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	73,343,367.64	56.95
	其中:股票	73,343,367.64	56.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,011,000.00	7.77
	其中:债券	10,011,000.00	7.77
	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	-	-
	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	44,835,467.26	34.81
8	其他资产	604,845.23	0.47
9	合计	128,794,680.13	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、渔业	-	-
B	采矿业	2,389,717.00	1.86
C	制造业	21,971,132.28	17.11
D	电力