国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金

2019年第一季度报告

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:2019年4月22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2019年4月18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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国都消费升级
场内简称	-
交易代码	004777
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7月3日
报告期末基金份额总额	17,430,868.39份
投资目标	本基金以基本面为立足点,精选消费升级中具有持续增长潜力的上市公司,以分享中国经济增长与结构转型带来的投资机会。通过积极主动的投资管理,在严格控制风险、保持良好流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金运用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法进行大类资产配置,强调通过“自上而下”的宏观分析与“自下而上”的行业与个股分析有机结合,进行前瞻性的决策。综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素,制定本基金资产的大类资产配置比例。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中证内地消费主题指数收益率×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1月1日-2019年3月31日)
1.本期已实现收益	794,103.04
2.本期利润	1,390,738.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0776
4.期末基金资产净值	12,069,567.30
5.期末基金份额净值	0.6924

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。

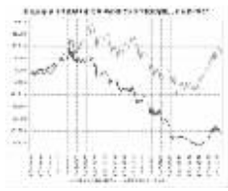
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	12.60%	1.27%	25.96%	1.30%	-13.36%	-0.03%

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		
尹德才	基金经理	2017年7月3日	-	7年	硕士,2011年加入天相投资顾问有限公司证券部研究员,2013年加入国都证券任研究所化工行业研究员、基金管理部高级行业研究员、基金经理助理,现任国都证券基金管理部基金经理。
张小强	基金经理	2017年7月3日	-	8年	硕士,曾任中国都牧兽医学会信息与市场研究部分析师,天相投资顾问有限公司分析师,国都证券研究所分析师,负责农业、食品等消费品行业研究。现任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《国都消费升级灵活配置混合型发起式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年一季度本基金平均仓位74%,基金净值增长12.60%,同期业绩比较基准上涨25.96%,产品业绩大幅跑输业绩比较基准,主要原因一是整体仓位较低,二是配置方向上与中证消费指数成分偏离较多,后者为主。

2019年一季度在市场监管明显放松、央行降准、科创板加速推出以及创业板多公司密集计提商誉减值等因素的影响下,市场风险偏好快速提升,各类题材、概念股轮番发力,市场活力和情绪提升明显,市场表现超过我们在年报当中对2019年行情的预期。

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0.6924元,份额累计净值0.6924元,一季度基金份额净值增长率12.60%,同期基金业绩比较基准增长率25.96%,本基金份额净值增长率低于业绩比较基准13.36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,本基金出现基金资产净值低于五千万元的情况。但是本基金为发起式基金,截至报告期末本基金基金合同生效未满三年,根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定,基金管理人不对本基金持有人数及基金资产净值进行监控。

根据本基金基金合同相关规定,基金合同生效之日起三年后的对应日,若基金资产净值规模低于2亿元,基金合同自动终止,且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。

§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	9,460,149.50	76.95
	其中:股票	9,460,149.50	76.95
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	2,524,123.37	20.53
8	其他资产	309,098.19	2.51
9	合计	12,293,371.06	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	910,330.00	7.54
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,719,823.50	55.68
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	353,376.00	2.93
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	249,000.00	2.06
J	金融业	-	-
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	93,820.00	0.78
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	669,800.00	5.55
R	文化、体育和娱乐业	464,000.00	3.84
S	综合	-	-
	合计	9,460,149.50	78.38

注:以上行业分类以2019年3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	002507	涪陵榨菜	18,000	558,360.00	4.63
2	300115	长盈精密	40,000	504,000.00	4.18
3	600887	伊利股份	17,000	494,870.00	4.10
4	300498	温氏股份	12,000	487,200.00	4.04
5	002384	东山精密	25,350	481,396.50	3.99
6	000858	五粮液	5,000	475,000.00	3.94
7	300144	宋城演艺	20,000	464,000.00	3.84
8	600519	贵州茅台	500	426,995.00	3.54
9	002299	圣农发展	17,000	423,130.00	3.51
10	002690	美亚光电	15,000	416,700.00	3.45

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。

(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

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	26,204.34
2	应收证券清算款	267,025.94
3	应收股利	-
4	应收利息	1,272.05
5	应收申购款	14,595.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	309,098.19

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	18,238,470.34
报告期期间基金总申购份额	46,046.93
减:报告期期间基金总赎回份额	853,648.88
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	17,430,868.39

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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	57.38

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,000.00	57.38	10,001,000.00	57.38	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,000.00	57.38	10,001,000.00	57.38	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	2019/01/01-2019/03/31	10,001,000.00	-	-	10,001,000.00	57.38%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

报告期内,本基金管理人发起资金持有份额比例超过基金总份额的20%且持有比例较大,除本基金招募说明书中列示的各项风险情形外,还包括因该类投资者巨额赎回可能导致的基金清盘风险和基金净值波动风险。

根据基金合同及相关法律法规约定,自基金成立之日起,基金管理人的发起资金持有基金份额不得少于3年,报告期内,本基金未发生上述相关风险事项。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、《国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新

2、《国都消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》及其更新

3、《国都消费升级灵活配置混合型发起式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

10.2 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

10.3 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
2019年4月22日

国都智能制造混合型发起式证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:国都证券股份有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月22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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月18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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国都智能制造
场内简称	-
交易代码	004935
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9月29日
报告期末基金份额总额	14,914,750.49份
投资目标	本基金投资于智能制造相关标的,力求把握中国实施制造强国战略的发展契机,紧追制造升级的高速发展趋势,在严格控制风险的前提下,努力获取超过业绩比较基准的收益,力求实现基金资产的长期、稳定增值。
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,同时,结合资本市场所处环境,最终形成大类资产配置决策。(1)宏观经济形势及国家政策的变化对资本市场影响深远。本基金将跟踪国家货币政策、财政政策、税收政策,以及CPI、PPI、PMI等各类宏观经济指标,构建宏观经济分析框架;(2)基于对宏观经济形势的判断,甄选具备投资机会的资产方向。(3)在各类资产预期收益率及风险分析的基础上,结合本基金的投资收益目标和风险控制要求,确定各大类资产的投资范围及配置比例。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中证装备产业指数收益率×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	广发银行股份有限公司

§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1月1日-2019年3月31日)
1.本期已实现收益	777,063.73
2.本期利润	1,819,591.39
3.加权平均基金份额本期利润	0.1099
4.期末基金资产净值	10,931,319.63
5.期末基金份额净值	0.7329

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。

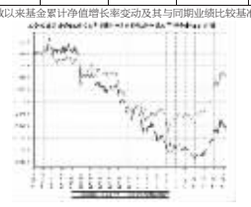
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	17.40%	1.49%	23.37%	1.33%	-5.97%	0.16%

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		
张崴	基金经理	2017年9月29日	-	12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。
张晓磊	基金经理	2018年12月17日	-	4年	北京航空航天大学航天工程学学士,University of Dayton宇航工程学硕士,曾任国都证券股份有限公司研究所研究员,基金管理部基金经理助理。现任国都证券基金管理部基金经理。
程广飞	基金经理	2017年9月29日	2018年12月24日	6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,担任研究所金融工程研究员、金融工程组负责人。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。

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《国都智能制造混合型发起式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年一季度,社会融资规模增速企稳回升,外资流入明显,在整体流动性改善的情况下A股出现明显反弹。截至1季度末,上证综指上涨23.93%,深圳成指上涨36.84%,上证50指数上涨23.78%。

权益市场的表现归根结底是对公司未来业绩成长预期的反映,后续行情的演绎需要有基本面改善作为支撑。3月份PMI/PPI/发电量等数据显示,经济短期有企稳迹象,如果经济改善态势持续,上涨行情有望走的更远;如果经济数据在短期改善后重回下跌通道,A股乐观的预期也将有所降温。

本基金聚焦中国制造业进行投资,向高端装备、智能制造、先进技术等方向进行倾斜。一季度,市场呈现普涨格局,尤其是龙头消费品涨幅居前,科技类标的超额收益不明显,但是,中国改革开放四十年发展至今,固定资产投资拉动的经济增长模式正在逐渐过去,未来从高速发展向高质量发展转变,科技引领的作用必然会越发凸显,我们对智能制造标的未来表现仍然充满信心。

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0.7329元,份额累计净值0.7329元,季度基金份额净值增长率17.40%。同期基金业绩比较基准增长率23.37%,本基金份额净值增长率低于业绩比较基准5.97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,本基金出现基金资产净值低于五千万元的情况。但是本基金为发起式基金,截至报告期末本基金基金合同生效未满三年,根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定,基金管理人不对本基金持有人数及基金资产净值进行监控。

根据本基金基金合同相关规定,基金合同生效之日起三年后的对应日,若基金资产净值规模低于2亿元,基金合同自动终止,且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。

§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	8,466,520.40	64.75
	其中:股票	8,466,520.40	64.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	641,716.20	4.91
	其中:债券	641,716.20	4.91
	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	1,100,005.50	8.41
	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	2,816,763.81	21.54
8	其他资产	50,063.74	0.38
9	合计	13,075,069.65	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	6,687,600.40	61.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	920,430.00	8.42
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	99,440.00	0.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	527,750.00	4.83
J	金融业	231,300.00	2.12
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	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	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,466,520.40	77.45

注:以上行业分类以2019年03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	603027	千禾味业	30,000	725,100.00	6.63
2	000661	长春高新	2,100	665,679.00	6.09
3	000860	顺鑫农业	10,000	606,300.00	5.55
4	000977	浪潮信息	21,600	540,000.00	4.94
5	603899	晨光文具	14,400	532,800.00	4.87
6	600406	国电南瑞	25,000	527,750.00	4.83
7	002008	大族激光	12,200	514,840.00	4.71
8	300750	宁德时代	5,500	467,500.00	4.28
9	603337	杰克股份	10,900	449,407.00	4.11
10	002035	华帝股份	32,000	448,960.00	4.11

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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	641,716.20	5.87
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	641,716.20	5.87

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113517	曙光转债	3,000	375,690.00	3.44
2	110046	圆通转债	1,190	145,025.30	1.33
3	113511	千禾转债	1,090	121,000.90	1.11

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。

(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套期保值为目的,将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

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

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	38,684.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,526.87
5	应收申购款	9,852.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,063.74

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113517	曙光转债	375,690.00	3.44
2	113511	千禾转债	121,000.90	1.11

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	16,956,428.21
报告期期间基金总申购份额	36,549.11
减:报告期期间基金总赎回份额	2,078,226.83
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	14,914,750.49

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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,009,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,009,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	67.11

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,009,000.00	67.11	10,009,000.00	67.11	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,009,000.00	67.11	10,009,000.00	67.11	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	2019/01/01-2019/03/31	10,009,000.00	-	-	10,009,000.00	67.11%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

报告期内,本基金管理人发起资金持有份额比例超过基金总份额的20%且持有比例较大,除本基金招募说明书中列示的各项风险情形外,还包括因该类投资者巨额赎回可能导致的基金清盘风险和基金净值波动风险。

根据基金合同及相关法律法规约定,自基金成立之日起,基金管理人的发起资金持有基金份额不得少于3年,报告期内,本基金未发生上述相关风险事项。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、《国都智能制造混合型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新

2、《国都智能制造混合型发起式证券投资基金基金合同》及其更新

3、《国都智能制造混合型发起式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

10.2 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

10.3 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
2019年4月22日

股票代码:600273 股票简称:嘉化能源 编号:2019-043
债券代码:136445 债券简称:G16嘉化1

浙江嘉化能源化工股份有限公司2016年绿色公司债券(第一期)票面利率不调整公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

重要提示:

- 调整前适用的票面利率:4.78%
- 票面利率是否调整:否
- 调整后适用的票面利率:4.78%
- 起息日:2019年5月23日

特别提示:

根据《浙江嘉化能源化工股份有限公司2016年公开发行绿色公司债券(第一期)募集说明书(面向合格投资者)》(以下简称“《募集说明书》”),浙江嘉化能源化工股份有限公司(以下简称“公司”、“发行人”)有权决定在浙江嘉化能源化工股份有限公司2016年公开发行绿色公司债券(债券简称“G16嘉化1”,债券代码“136445”,以下简称“本期债券”)存续的第3年末是否上调后2年的票面利率。根据当前的市场环境,公司决定票面利率不变,存