

# 国都智能制造混合型发起式证券投资基金 2018 年第 4 季度报告

2018 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：广发银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 1 月 19 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 1 月 17 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 2018 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	16,956,428.21 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( 2018 年 10 月 1 日 — 2018 年 12 月 31 日 )
1. 本期已实现收益	-1,021,875.24
2. 本期利润	-1,266,755.26
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0740
4. 期末基金资产净值	10,586,016.11
5. 期末基金份额净值	0.6243

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。

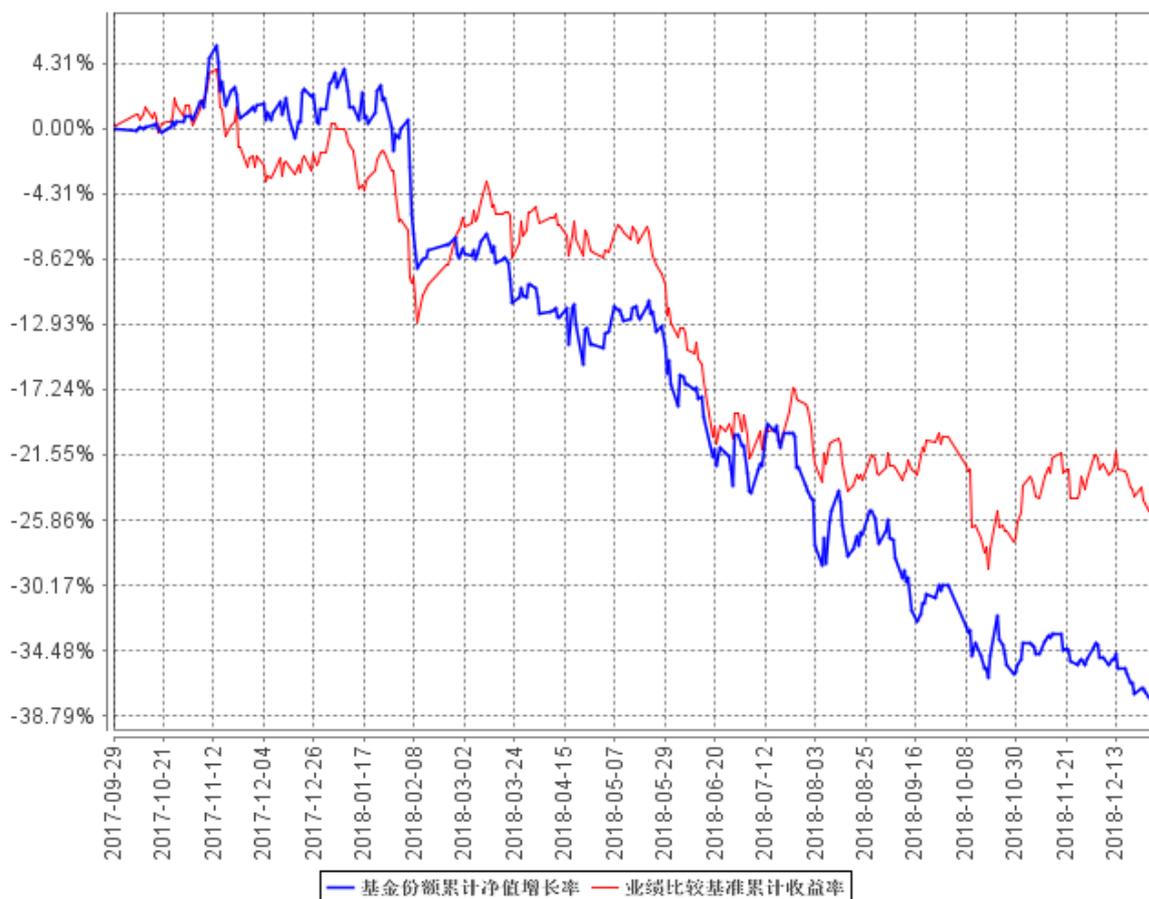
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	-10.57%	1.13%	-5.82%	1.29%	-4.75%	-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

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



### 3.3 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	-	11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

2018 年四季度，各项宏观数据继续延续回落态势。社会融资规模增速继续回落，工业企业利润增速快速回落，PMI 指数下滑到荣枯分界线以下。市场对经济的担忧逐渐从预期转变成现实。中美两国元首虽然在 12 月末阿根廷会议上展开沟通，但随后某公司高管事件让两国关系再次承压。在诸多不利因素影响下，A 股各主要指数四季度继续跌势，上证综指单季度下跌 11.61%，深圳成指下跌 13.82%，沪深 300 指数下跌 12.45%，中小板指数下跌 18.22%。

本产品聚焦于中国智能制造方向，以制造业为主，重点布局对产业方向由引领作用的高端制造业，其中科技类公司占比较大。在中美贸易纷争阶段，美国遏制中国科技发展的意图明显，对国内高端制造业造成压力，本产品重点投资的几大制造业板块都有较大回撤。虽然面临较大外部压力，但科技振兴是中国走向强大的必经之路，中国政府继续对高科技产业给与重点支持。我们将继续聚焦于挖掘和投资质地优良的标的，在价格底部区间做好布局，力争提升投资者回报水平。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截止 2018 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.6243 元，份额累计净值 0.6243 元，季度基金份额净值增长率-10.57%。同期基金业绩比较基准增长率-5.82%，本基金份额净值增长率低于业绩比较基准 4.75 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	4,958,264.00	45.18
	其中：股票	4,958,264.00	45.18
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	4,400,022.00	40.10
	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	1,199,234.67	10.93
8	其他资产	416,316.31	3.79
9	合计	10,973,836.98	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	325,600.00	3.08
B	采矿业	-	-

C	制造业	3,989,504.00	37.69
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	219,400.00	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	120,600.00	1.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	303,160.00	2.86
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	-	-
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	4,958,264.00	46.84

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

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	002859	洁美科技	16,600	510,450.00	4.82
2	002008	大族激光	14,400	437,184.00	4.13
3	300408	三环集团	24,600	416,232.00	3.93
4	002601	龙蟠佰利	28,000	344,400.00	3.25
5	000998	隆平高科	22,000	325,600.00	3.08
6	300003	乐普医疗	15,300	318,393.00	3.01
7	603337	杰克股份	8,600	315,534.00	2.98
8	603027	千禾味业	20,400	313,752.00	2.96
9	000977	浪潮信息	19,400	308,848.00	2.92
10	300559	佳发安泰	8,800	303,160.00	2.86

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

本基金的股指期货投资以套期保值为目的，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	59,073.20
2	应收证券清算款	357,674.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-431.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	416,316.31

### 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	17,278,556.44
报告期期间基金总申购份额	25,726.27
减：报告期期间基金总赎回份额	347,854.50
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	16,956,428.21

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额比例（%）	59.03

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	持有份额占基金总额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,009,000.00	59.03	10,009,000.00	59.03	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	59.03	10,009,000.00	59.03	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	2018/10/01-2018/12/31	10,009,000.00	-	-	10,009,000.00	59.03%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据我公司第一届董事会第二十次会议决议，自 2018 年 12 月 3 日起，由赵远峰担任总经理职务。

## § 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](http://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](http://www.guodu.com)）查阅。

国都证券股份有限公司

2019 年 1 月 19 日