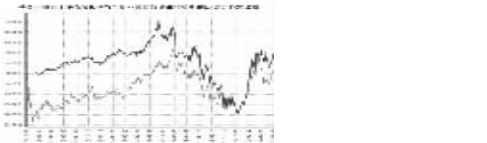


# 信息披露 Disclosure

## 国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

### 2019年第二季度报告

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 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
薛京京	基金经理	2015年12月28日 - 8年		经济学硕士,2011年进入国都证券,历任资产管理部总经理助理、投资管理部研究员、投资管理部副经理,现任国都证券资产管理部基金经理、公募证券投资基金业务决策委员会成员。

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。本基金无法法、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《证券投资基金管理人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超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年二季度,由于中美贸易战再次进入博弈阶段,人民币汇率预期再起,年初市场预计的货币宽松预期落空,加之前期市场涨幅较大,多重利空因素的影响下,市场普遍下行,上证综指跌幅3.62%,中小板指数跌幅10.99%,创业板指数跌幅10.76%。

本基金一直聚焦于消费、医药、科技三个行业,通过逆向投资的办法跟踪相关行业,尤其是行业龙头的投资机会。由于基金产品重仓持有的消费股和部分高成长股虽然经历了一定程度的下跌,但是基于基本面扎实,在经历了一定的调整之后,又重新向上上涨趋势,部分股票甚至创下了市场新高。未来,本基金关注的重点依然是消费、医药、科技三大领域,我们会对行业当中的优质公司保持高度的关注,努力让投资人赚取超额回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现  
截止2019年6月30日,本基金份额净值为1.037元,份额累计净值1.077元,季度基金份额净值增长22.27%,同期基金业绩比较基准增长率-0.96%,本基金份额净值增长率高于业绩比较基准3.22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的情形,截至报告期末,本基金资产净值仍低于五千万。

#### § 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	30,031,238.40	90.56
	其中:股票	30,031,238.40	90.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	黄金投资	-	-
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	3,036,242.43	9.16
8	其他资产	96,211.01	0.29
9	合计	33,162,691.84	100.00

注:由于计算中四舍五入的原因,本报告分之和与合计数之间可能存在尾差。

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	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	4,122,080.00	12.63
B	采矿业	-	-
C	制造业	21,871,688.40	67.00
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应业	-	-
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	1,497,000.00	4.59
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	1,300,200.00	3.98
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	1,240,280.00	3.80
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		30,031,238.40	92.00

注:以上行业分类以2019年06月30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	600434	片仔癀	20,000	2,304,000.00	7.06
2	000876	新希望	110,400	1,917,648.00	5.87
3	002070	润兴股份	60,000	1,830,000.00	5.61
4	003707	捷友股份	50,000	1,767,500.00	5.41
5	002269	圣农发展	69,000	1,747,080.00	5.36
6	002204	洋河股份	14,000	1,701,840.00	5.21
7	300760	迈瑞医疗	10,000	1,632,000.00	5.00
8	600228	安图医疗	50,000	1,581,500.00	4.94
9	002234	天目药业	50,000	1,390,500.00	4.29
10	002211	海大集团	45,000	1,390,500.00	4.28

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和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 本基金股指期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金国债期货期末持仓和损益情况

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。