

国都多策略混合型证券投资基金

2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 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：2023 年 7 月 20 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 2023 年 7 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 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。本基金自 2023 年 7 月 5 日起进入清算程序。

§ 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
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	1,794,442.06 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	本基金采用多种投资策略和交易手段进行大类资产配置和股票的行业配置，在预防出现单一策略可能失效的情况下，保证整体投资业绩的稳健持续性。
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，其长期平均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。
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（2023 年 4 月 1 日 — 2023 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-202,275.29
2. 本期利润	-148,296.10
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0569
4. 期末基金资产净值	2,451,118.13
5. 期末基金份额净值	1.3659

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。

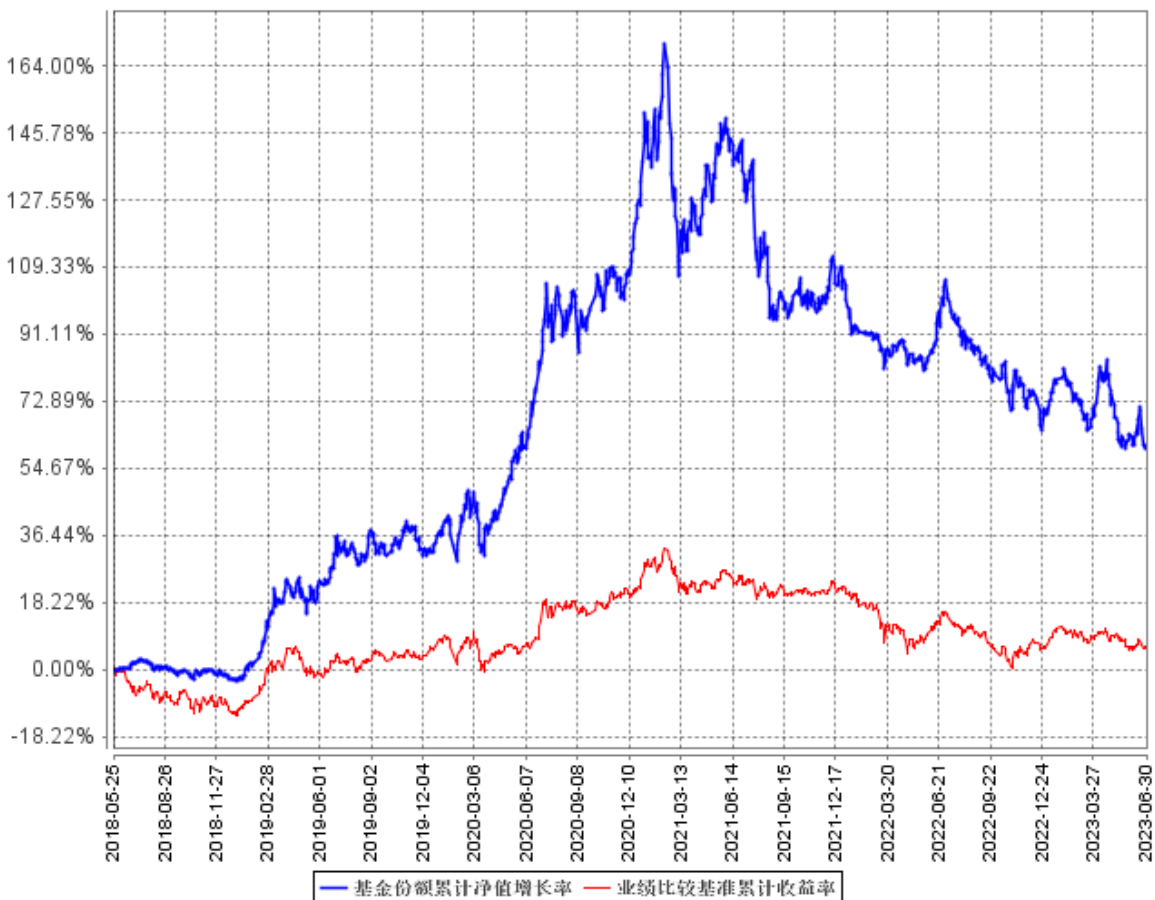
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	-6.45%	1.29%	-2.67%	0.49%	-3.78%	0.80%
过去六个月	-5.13%	1.05%	0.00%	0.50%	-5.13%	0.55%
过去一年	-20.60%	0.97%	-8.09%	0.59%	-12.51%	0.38%
过去三年	-12.27%	1.22%	-2.57%	0.71%	-9.70%	0.51%
过去五年	58.47%	1.16%	11.40%	0.76%	47.07%	0.40%
自基金合同 生效起至今	61.27%	1.15%	6.26%	0.76%	55.01%	0.39%

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		
王义	基金经理	2021年6月16日	-	5年	曾任国都证券股份有限公司研究所医药行业研究员，现任国都

					证券投资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。
--	--	--	--	--	--------------------------------------

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无

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

2023 年二季度，海外方面，虽然硅谷银行事件和美国政府债务上限问题引发过对于美国经济深度衰退的担忧，但是美国上半年仍旧强劲的就业数据，使得深度衰退的预期进一步缓解。总的来说，站在当前时间点预判，美国经济软着陆愈发成为大概率事件。通胀问题虽有所缓解，但是高利率态势仍可能会维持较长时间。

国内方面，经济强复苏的预期逐渐被证伪，诚如我们在本基金第一季度报告中提到的“从驱

动经济增长的‘三驾马车’来看，影响较大且变数较多的主要在地产方面”，目前仍未看到地产相关行业的复苏，同时考虑到当前社会总需求仍然偏弱，故我们对于年内经济复苏的强度仍旧呈谨慎态度。但是我们认为，复苏的大趋势是确定的，且国内货币政策也有趋松迹象，故我们对于未来 A 股的表现持乐观态度。

考虑上述因素，本基金运作上采取了相对积极的操作策略。布局以 AIGC 为主导的新产业趋势以及与经济总量相关性较小的板块。重点是通信、半导体、消费医疗、创新药等领域。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.3659 元，份额累计净值 1.6525 元，二季度基金份额净值增长率-6.45%，同期基金业绩比较基准增长率-2.67%。

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，本基金存在连续二十个工作日出现基金持有人数量不满二百人和连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。截至本报告期末，本基金的基金持有人数量仍不满二百人且基金资产净值仍低于人民币五千万元。本基金管理人已按法规要求向监管机关报送解决方案。

§ 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	1,084,531.60	44.05
	其中：股票	1,084,531.60	44.05
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	1,375,022.81	55.85
8	其他资产	2,463.83	0.10
9	合计	2,462,018.24	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	745,487.60	30.41
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	122,100.00	4.98
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	216,944.00	8.85
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	1,084,531.60	44.25

注：以上行业分类以 2023 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	603939	益丰药房	3,300	122,100.00	4.98
2	000100	TCL 科技	30,000	118,200.00	4.82
3	688331	荣昌生物	1,800	100,350.00	4.09
4	688232	新点软件	1,800	96,858.00	3.95
5	688276	百克生物	1,500	93,900.00	3.83
6	300308	中际旭创	600	88,470.00	3.61
7	300122	智飞生物	2,000	88,400.00	3.61
8	603369	今世缘	1,500	79,200.00	3.23
9	000568	泸州老窖	300	62,871.00	2.56
10	603019	中科曙光	1,200	61,080.00	2.49

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

TCL 科技集团股份有限公司董事、高级管理人员王成先生，因其原任职的公司收购项目中未按规定履行报告、公告义务，未按规定履行发出收购要约义务等行为，2023 年 1 月 18 日中国证券监督管理委员会广东证监局决定对王成先生给予警告，并处以 100 万元罚款。（中国证券监督管理委员会广东监管局《行政处罚决定书》（2023）1 号）

除此之外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	2,166.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	297.77
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,463.83

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	2,108,762.17
报告期期间基金总申购份额	3,143,081.33
减：报告期期间基金总赎回份额	3,457,401.44
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	1,794,442.06

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

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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	2023-05-29 至 2023-06-13	0.00	1,309,472.99	1,309,472.99	0.00	0.00%
产品特有风险							
报告期内，因本基金出现部分投资者巨额赎回的情况，导致部分投资者持有份额比例超过基金总份额的 20%且占比较大，基金管理人已按照法律法规规定和基金合同要求，充分做好流动性风险管理准备，未发生流动性风险。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金于 2023 年 6 月 6 日起至 2023 年 6 月 30 日期间以通讯方式召开了本基金基金份额持有人大会，大会于 2023 年 7 月 3 日表决通过了《关于终止国都多策略混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。自 2023 年 7 月 5 日起，本基金进入清算程序，基金管理人不再接受持有人提出的本基金的份额申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管等申请。本基金进入清算程序后，

停止收取基金管理费、基金托管费。详情可见基金管理人网站（www.guodu.com）刊登的《国都证券股份有限公司关于国都多策略混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。

§ 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》及其更新
- 3、《国都多策略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

2023 年 7 月 20 日