

# 国泰智能装备股票型证券投资基金

## 2019 年第 2 季度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年七月十八日

## § 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2019 年 7 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                   |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰智能装备股票                                                                                                                          |
| 基金主代码      | 001576                                                                                                                            |
| 交易代码       | 001576                                                                                                                            |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                            |
| 基金合同生效日    | 2017 年 6 月 21 日                                                                                                                   |
| 报告期末基金份额总额 | 694,800,453.21 份                                                                                                                  |
| 投资目标       | 本基金主要投资于智能装备主题股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。                                                                                     |
| 投资策略       | <p>本基金在投资运作中，淡化大类资产配置，侧重在智能装备主题下精选个股，以期实现基金资产的稳健增值。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>在国内制造业转型的过程中，智能装备的发展不可忽视。首先，制造业升级需要智能装备帮助一般制造业从繁重的</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>人力劳动中解脱，降低生产成本，更多的投入到研发和服务中去，并逐渐建立新的发展模式。其次，实现装备的智能化及制造过程的自动化，将使得产业生产效率、产品技术水平和质量得到显著提高，能源、资源消耗和污染物的排放明显降低。最后，国内劳动力成本上涨明显，人口红利正逐渐减弱，劳动力成本的上涨将很大程度上拉动智能装备发展。有理由相信，在未来相对较长的一段时间里，智能装备将伴随产业升级得到长足发展。</p> <p>（1）智能装备主题的界定</p> <p>本基金所指的智能装备是指具有预测、感知、分析、推理、决策、控制功能，可实现生产效率提升和生产流程优化的装备总称。智能装备是先进制造技术、信息技术和人工智能技术在装备产品上的集成和融合，它不仅局限于装备，还包括基于装备所构建的商业环境和盈利模式。</p> <p>本基金界定的智能装备主题涵盖范围包括但不限于高档数控机床与基础制造装备，自动化成套生产线，智能控制系统，精密和智能仪器仪表与试验设备，关键基础零部件、元器件及通用部件，智能国防装备，智能专用装备，机器人，3D 打印等。智能装备的概念将随着科技进步而不断更新发展，基金管理人将持续跟踪科技进步及商业模式发展，对智能装备主题所涉及领域进行更新调整。</p> <p>本基金界定的智能装备主题股票应至少符合以下标准之一：1）上市公司目前主营业务隶属于上述智能装备主题涵盖范围的；2）上市公司目前非主营业务隶属于上述智能装备主题涵盖范围，但该部分业务有可能转型为主营业务并成为公司主要利润来源的；3）上市公司未来转型方向或重点发展业务隶属于上述智能装备主题涵盖范围的。</p> <p>（2）个股投资策略</p> <p>本基金根据上市公司获利能力、成长能力、估值水平等指</p> |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>标精选个股。运用定性和定量相结合的方法，综合分析其投资价值和成长能力，确定投资标的股票，构建投资组合。</p> <p>2、固定收益类投资工具投资策略</p> <p>本基金密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合，配置能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合，保证基金资产流动性。</p> <p>3、股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货以套期保值为主要目的，将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本，并利用股指期货的对冲作用，降低股票组合的系统性风险。</p> <p>4、中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金在严格控制风险的前提下，综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特征，选择具有相对优势的品种，在严格遵守法律法规和《基金合同》基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>6、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风</p> |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|        |                                                                   |
|--------|-------------------------------------------------------------------|
|        | 险套利，尽力减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。                                        |
| 业绩比较基准 | 中证高端装备制造指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%                                  |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 |
| 基金管理人  | 国泰基金管理有限公司                                                        |
| 基金托管人  | 中国银行股份有限公司                                                        |

### § 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<br>(2019 年 4 月 1 日-2019 年 6 月 30 日) |
|-----------------|-----------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 19,764,999.73                           |
| 2. 本期利润         | -67,289,991.73                          |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0831                                 |
| 4. 期末基金资产净值     | 703,287,479.15                          |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.012                                   |

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 | 业绩比较基准收益 | 业绩比较基准收益 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|----------|----------|----------|-----|-----|
|----|--------|----------|----------|----------|-----|-----|

|       |        | ②     | 率③     | 率标准差<br>④ |        |       |
|-------|--------|-------|--------|-----------|--------|-------|
| 过去三个月 | -7.58% | 1.65% | -7.33% | 1.53%     | -0.25% | 0.12% |

### 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

国泰智能装备股票型证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2017 年 6 月 21 日至 2019 年 6 月 30 日)



注：本基金的合同生效日为2017年6月21日，本基金的建仓期为6个月，在建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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 |        |              |
| 周伟锋 | 本基金 | 2017-06-21  | -    | 11 年   | 硕士研究生。曾任中国航天 |

|  |                                                                                     |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>的基金经理、国泰价值经典灵活配置混合（LOF）、国泰金鹰增长灵活配置混合、国泰智能汽车股票、国泰价值精选灵活配置混合、国泰价值优选灵活配置混合的基金经理</p> |  |  | <p>科技集团西安航天发动机厂技术员,2008 年 7 月加盟国泰基金,历任研究员,高级研究员,2012 年 1 月至 2013 年 6 月任国泰金鹰增长证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）的基金经理助理,2013 年 6 月至 2014 年 7 月任国泰中小盘成长股票型证券投资基金的基金经理,2014 年 3 月起兼任国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由原国泰价值经典混合型证券投资基金（LOF）变更而来,国泰价值经典混合型证券投资基金（LOF）由国泰价值经典股票型证券投资基金（LOF）更名而来）的基金经理,2015 年 1 月至 2016 年 12 月任国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015 年 5 月起兼任国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金（由原国泰金鹰增长混合型证券投资基金变更注册而来,国泰金鹰增长混合型证券投资基金由国泰金鹰增长证券投资基金变更而来）的基金经理,2015 年 8 月至 2016 年 8 月任国泰互联网+股票型证券投资基金的基金经理,2016 年 8 月至 2017 年 9 月任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理,2017 年 6 月起兼任国泰智能装备股票型证券投资基金的基金经理,2017 年 8 月起兼任国泰智能汽车股票型证券投资基金的基金经理,2018 年 8 月起兼任国泰价值精选灵活配置混</p> |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|    |          |            |   |     |                                                                                                                                 |
|----|----------|------------|---|-----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |          |            |   |     | 合型证券投资基金的基金经理,2019 年 1 月起兼任国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。                                                                            |
| 王阳 | 本基金的基金经理 | 2018-11-13 | - | 8 年 | 硕士研究生。2011 年 5 月至 2018 年 7 月在平安资产管理有限责任公司工作,先后任研究员、助理投资经理、投资经理,2018 年 7 月加入国泰基金管理有限公司,拟任基金经理。2018 年 11 月起任国泰智能装备股票型证券投资基金的基金经理。 |

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 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《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

## 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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

进入到 2019 年二季度，随着一季度降税减费和财政支出的预期落地，同时外围不利环境再次出现，叠加国内经济数据环比回落，且权益市场整体估值已相较年初大幅修复，权益市场出现一波明显的回落。

在基金操作上，寻找中长期具有领先优势的细分行业和龙头公司，在估值处于历史相对低位时进行选择配置。同时，关注在中国转型的“新机遇”阶段，重点选择新科技和新消费行业中的优质公司进行配置。综合来看，我们以选择细分行业中的龙头公司作为研究和投资的重要方向，并且积极寻找新的投资机会。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰智能装备在 2019 年第二季度的净值增长率为-7.58%，同期业绩比较基准收益率为-7.33%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年三季度，我们判断中国经济仍然会在一个相对较为稳定的环境下运行，并且经济结构有进一步优化的可能性。货币政策应该会相对稳定，在结构上预计会对“新经济”和“新机遇”方向上进行支持。外围环境还待观察，但整体压力较二季度会有所恢复。

预期我国将逐步从经济总量型社会向结构优化型社会转型，我们更多在结构型的市场中寻找新经济增长的方向，在经济产业转型中发掘未来的行业龙头。

我们将结合自上而下和自下而上的两个维度去寻找优质公司，自上而下寻找新经济方向，自下而上挖掘具有核心资源、技术、渠道等质地的公司。综合来看，我们寻找如下几个方向：（1）能源结构转型，我国作为能源消耗大国，对外能源依存度较高，解决能源问题需逐步转化能源结构并积极发展新能源产业，新能源汽车、光伏、风电等都是新旧能源转化的方向；（2）先进制造业，计算机科技、汽车的电动和智能化、工业先进制造等领域都是增强我国硬实力的方向。（3）消费升级，人口基数已奠定我国是一个消费大国，随着中国自身经济实力的增强，人们的物质升级需求日益提升，消费电子、轻工制造、医药生物等领域会产

生巨大的新增消费空间。

一如既往地，为持有人创造稳健良好的中长期收益回报是我们永远不变的目标。在追求收益的同时，我们将持续关注风险与价值的匹配度，做好风险控制。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 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              | 651,426,210.79 | 91.41        |
|    | 其中：股票             | 651,426,210.79 | 91.41        |
| 2  | 固定收益投资            | 8,099,515.20   | 1.14         |
|    | 其中：债券             | 8,099,515.20   | 1.14         |
|    | 资产支持证券            | —              | —            |
| 3  | 贵金属投资             | —              | —            |
| 4  | 金融衍生品投资           | —              | —            |
| 5  | 买入返售金融资产          | —              | —            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —              | —            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 52,609,256.83  | 7.38         |
| 7  | 其他各项资产            | 487,969.48     | 0.07         |
| 8  | 合计                | 712,622,952.30 | 100.00       |

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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              | 363,431.25     | 0.05  |
| C | 制造业              | 552,518,649.04 | 78.56 |
| 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           | 31,625,984.00  | 4.50  |
| 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  | 66,861,169.96  | 9.51  |
| J | 金融业              | 33,869.94      | 0.00  |
| 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        | 23,106.60      | 0.00  |
| S | 综合               | -              | -     |
|   | 合计               | 651,426,210.79 | 92.63 |

### 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  | 601012 | 隆基股份 | 1,863,716 | 43,070,476.76 | 6.12         |
| 2  | 002475 | 立讯精密 | 1,550,508 | 38,437,093.32 | 5.47         |
| 3  | 601799 | 星宇股份 | 466,272   | 36,816,837.12 | 5.23         |
| 4  | 002050 | 三花智控 | 3,443,553 | 36,285,290.55 | 5.16         |
| 5  | 600438 | 通威股份 | 2,565,102 | 36,065,334.12 | 5.13         |
| 6  | 300616 | 尚品宅配 | 457,966   | 34,631,388.92 | 4.92         |
| 7  | 603515 | 欧普照明 | 1,068,251 | 34,451,094.75 | 4.90         |
| 8  | 300124 | 汇川技术 | 1,465,354 | 33,571,260.14 | 4.77         |
| 9  | 600885 | 宏发股份 | 1,377,362 | 33,469,896.60 | 4.76         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 10 | 603337 | 杰克股份 | 1,613,698 | 33,064,672.02 | 4.70 |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|

#### 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      | 8,099,515.20 | 1.15         |
| 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） | —            | —            |
| 8  | 同业存单      | —            | —            |
| 9  | 其他        | —            | —            |
| 10 | 合计        | 8,099,515.20 | 1.15         |

#### 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  | 019611 | 19 国债 01 | 81,060 | 8,099,515.20 | 1.15         |

#### 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

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

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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人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。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称    | 金额(元)      |
|----|-------|------------|
| 1  | 存出保证金 | 220,323.01 |

|   |         |            |
|---|---------|------------|
| 2 | 应收证券清算款 | -          |
| 3 | 应收股利    | -          |
| 4 | 应收利息    | 100,445.27 |
| 5 | 应收申购款   | 167,201.20 |
| 6 | 其他应收款   | -          |
| 7 | 待摊费用    | -          |
| 8 | 其他      | -          |
| 9 | 合计      | 487,969.48 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的<br>公允价值(元) | 占基金资产净<br>值比例(%) | 流通受限情<br>况说明 |
|----|--------|------|--------------------|------------------|--------------|
| 1  | 002050 | 三花智控 | 1,015,448.40       | 0.14             | 增发中签         |

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|              |                |
|--------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 795,186,643.86 |
| 报告期基金总申购份额   | 121,331,845.69 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 221,718,036.34 |
| 报告期基金拆分变动份额  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额 | 694,800,453.21 |

### § 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

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰智能装备股票型证券投资基金注册的批复
- 2、国泰智能装备股票型证券投资基金基金合同
- 3、国泰智能装备股票型证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

### 8.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

本基金托管人住所。

### 8.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：(021) 31089000，400-888-8688

客户投诉电话：(021) 31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇一九年七月十八日