国投瑞银新能源混合型证券投资基金
2022年中期报告
2022年6月30日

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
2 基金简介.....5
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....6
2.4 信息披露方式.....6
2.5 其他相关资料.....6
3 主要财务指标和基金净值表现.....7
3.1 主要会计数据和财务指标.....7
3.2 基金净值表现.....7
4 管理人报告.....10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....14
5 托管人报告.....15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....15
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....15
6.1 资产负债表.....15
6.2 利润表.....17
6.3 净资产（基金净值）变动表.....18
6.4 报表附注.....20
7 投资组合报告.....49
7.1 期末基金资产组合情况.....49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....50
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....57
7.6 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.....58
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....58
7.8 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贵金属投资明细.....58
7.9 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.....58
7.10 基金投资股指期货的投资政策.....58

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....59
7.12 投资组合报告附注.....59
8 基金份额持有人信息.....60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....60
9 开放式基金份额变动.....61
10 重大事件揭示.....61
10.1 基金份额持有人大会决议.....61
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....61
10.4 基金投资策略的改变.....61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....62
10.8 其他重大事件.....63
11 影响投资者决策的其他重要信息.....64
11.1 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.....64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....65
12 备查文件目录.....65
12.1 备查文件目录.....65
12.2 存放地点.....65
12.3 查阅方式.....65

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国投瑞银新能源混合型证券投资基金	
基金简称	国投瑞银新能源混合	
基金主代码	007689	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年11月18日	
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,631,777,239.17份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国投瑞银新能源混合A	国投瑞银新能源混合C
下属分级基金的交易代码	007689	007690
报告期末下属分级基金的份额总额	1,478,686,742.58份	1,153,090,496.59份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过股票与债券等资产的合理配置，并精选新能源主题的相关上市公司股票进行投资，力争基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括类别资产配置策略、股票投资管理策略和债券投资管理策略等。 1、类别资产配置 本基金根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的比较判别，对股票（包括A股和港股通标的股票）、债券及货币市场工具等各资产类别的配置比例进行动态调整，以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。 2、股票投资管理 本基金通过对新能源主题相关行业进行深入细致的研究分析，秉承价值投资的理念，深入挖掘新能源主题相关行业股票的投资价值，分享新能源主题所带来的投资机会。 构建股票组合的步骤是：界定新能源主题相关行业并确定股票初选库；基于公司基本面全面考量、筛选优势企业，运用现金流贴现模型等估值方法，分析股票内在价值；结合风险管理，构建股票组合并对其进行动态调整。 3、股指期货投资管理 为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。本基金利用股指期货流

	动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。 4、债券投资管理 本基金采取“自上而下”的债券分析方法，确定债券投资组合，并管理组合风险。 5、对于资产支持证券，其定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，以数量化模型确定其内在价值。
业绩比较基准	中证新能源指数收益率×60% +恒生工业行业指数收益率（使用估值汇率折算）×20% +中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国投瑞银基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王明辉	许俊
	联系电话	400-880-6868	95566
	电子邮箱	service@ubssdic.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-880-6868	95566
传真		0755-82904048	010-66594942
注册地址		上海市虹口区杨树浦路168号20层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		518035	100818
法定代表人		傅强	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ubssdic.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国投瑞银基金管理有限公司	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022年1月1日至2022年6月30日）	
	国投瑞银新能源混合A	国投瑞银新能源混合C
本期已实现收益	-495,222,363.32	-438,325,222.05
本期利润	50,494,156.98	170,764,926.89
加权平均基金份额本期利润	0.0361	0.1405
本期加权平均净值利润率	1.22%	4.82%
本期基金份额净值增长率	1.88%	1.68%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2022年6月30日)**	
	国投瑞银新能源混合A	国投瑞银新能源混合C
期末可供分配利润	907,467,249.00	679,116,921.21
期末可供分配基金份额利润	0.6137	0.5890
期末基金资产净值	5,132,392,229.68	3,960,700,185.70
期末基金份额净值	3.4709	3.4349
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2022年6月30日)**	
	国投瑞银新能源混合A	国投瑞银新能源混合C
基金份额累计净值增长率	269.87%	266.05%

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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、以上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（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际利润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

国投瑞银新能源混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	18.83%	2.50%	11.92%	1.44%	6.91%	1.06%
过去三个月	21.24%	2.89%	11.29%	1.86%	9.95%	1.03%
过去六个月	1.88%	2.74%	-4.30%	1.78%	6.18%	0.96%
过去一年	39.13%	2.80%	3.80%	1.70%	35.33%	1.10%
自基金合同生效起至今	269.87%	2.38%	121.45%	1.63%	148.42%	0.75%

国投瑞银新能源混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	18.79%	2.50%	11.92%	1.44%	6.87%	1.06%
过去三个月	21.12%	2.89%	11.29%	1.86%	9.83%	1.03%
过去六个月	1.68%	2.74%	-4.30%	1.78%	5.98%	0.96%
过去一年	38.58%	2.80%	3.80%	1.70%	34.78%	1.10%
自基金合同生效起至今	266.05%	2.38%	121.45%	1.63%	144.60%	0.75%

注：1、中证新能源指数是由中证指数有限公司编制的，以中证全指为样本空间，选取涉及可再生能源生产、新能源应用、新能源存储以及新能源交互设备等业务的上市公司股票作为成份股，以反映新能源产业相关上市公司的整体表现。恒生工业行业指数是由恒生指数服务有限公司编制，是恒生综合指数 11 个行业指数之一，以反映工业行业在香港股票市场的表现，于 2001 年 10 月 3 日推出。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场、不同发行主体和期限，能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。综合考虑基金资产配置与市场指数代表性等因素，本基金选用中证新能源指数、恒生工业行业指数和中债综合指数加权作为本基金的投资业绩评价基准。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

国投瑞银新能源混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2019 年 11 月 18 日至 2022 年 6 月 30 日）

国投瑞银新能源混合 A

国投瑞银新能源混合 C

注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各

项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国投瑞银基金管理有限公司（简称"公司"），原中融基金管理有限公司，经中国证券监督管理委员会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本1亿元人民币。公司是中国第一家外方持股比例达到49%的合资基金管理公司，公司股东为国投泰康信托有限公司（国家开发投资公司的控股子公司）及瑞士银行股份有限公司（UBS AG）。公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制架构，以"诚信、创新、包容、客户关注"作为公司的企业文化。截止2022年6月底，在公募基金方面，公司共管理82只基金 ，已建立起覆盖高、中、低风险等级的完整产品线；在专户理财业务方面，自2008年获得特定客户资产管理业务资格以来，已成功运作管理的专户产品涵盖了灵活配置型、稳健增利型等常规产品，还包括分级、期指套利、商品期货、QDII等创新品种；在境外资产管理业务方面，公司自2006年开始为QFII信托计划提供投资咨询服务，具有丰富经验，并于2007年获得QDII资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
施成	本基金基金经理，研究部部门副总监	2019-11-18	-	11	中国籍，硕士，具有基金从业资格。2011年7月至2012年12月任中国建银投资证券有限责任公司研究员，2012年12月至2015年7月任招商基金管理有限公司研究员，2015年7月至2017年3月任深圳睿泉毅信投资管理有限公司高级研究员。2017年3月加入国投瑞银基金管理有限公司研究部。现任国投瑞银先进制造混合型证券投资基金、国投瑞银新能源混合型证券投资基金、国投瑞银进宝灵活配置混合型证

					券投资基金、国投瑞银产业趋势混合型证券投资基金、国投瑞银产业升级两年持有期混合型证券投资基金及国投瑞银产业转型一年持有期混合型证券投资基金基金经理。

注：任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其系列法规和本基金《基金合同》等有关规定，本着恪守诚信、审慎勤勉，忠实尽职的原则，为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。在报告期内，基金的投资决策规范，基金运作合法合规，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人通过制度、流程和技术手段保证了公平交易原则的实现，确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督，形成了有效地公平交易体系。本报告期，本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

报告期内，管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。本年度同向交易价差专项分析的情况如下：

1、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差的溢价率进行分析，对两两组合同向交易成交价格均值的溢价率是否趋近于零进行T检验，检验在95%的可信水平下，价格均值的溢价率趋近于零是否存在检验不通过的情况。

2、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差优劣进行比较，区分买优、卖优、买次、卖次等情况分别分析两两组合在期间内交易时是否存在显著优于另一方的异常情况，

3、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差区分两两组合进行利益输送的模拟测算，检查在过去四个季度内，是否存在显著异常的情况。

检验分析结果显示，公司管理的所有投资组合，在过去连续四个季度内未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与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总成交量5%的交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年投资总结，我们看好以国内新能源为代表的成长行业的需求增量和供给大部分由海外提供的环节。如果其处于成长行业，由于需求本身的快速增长，其逻辑很可能继续强化。

新兴产业内部的盈利持续向上游转移，中下游其他环节的盈利在被压缩，这一状态在下半年仍然会继续。由于资源品的瓶颈，最快也要到2023年底才能够缓解，所以只要需求向好，上游就要分割利润，这是客观规律，不以人的意志为转移。

从4月下旬开始，中下游的子行业和公司出现了较大幅度的上涨，并在6月涨幅超过了上游。我们认为从行业传导顺序以及美林时钟可以解释这一现象。从美林时钟来看，经济周期从衰退——复苏——过热——滞涨，复苏阶段制造业更好，过热阶段资源品优势更大；从行业传导来看，下游订单上升——中游排产提高——上游资源短缺。只要上游资源品供给有限且下游需求旺盛，演绎只是时间问题，即最终行业轮动要回归上游。在目前经历了新能源中下游股价的大幅上涨，我们认为从流动性到行业基本面，都支撑上游迎来行情。

具体行业来看，设备制造业方面，投向仍然集中于光伏、锂电、半导体等具备快速增长动能的行业。目前来看，市场对于新技术方向的设备改进和资本开支更有热情，

这是我们未来会重点关注的方向。

新能源汽车方面，我们依然看好电动汽车销量的较快增长，目前需求方面怀疑的人已经逐渐减少，但对于供给端资源品价格的进一步上行仍有争议。我们认为由于国家刺激汽车消费，一、二线城市出台了不少地补来推动，这些城市地补的规模明显缓解了上游资源涨价带来的压力，使得中国车企能够在全球范围内去采购更多的碳酸锂（这也会进一步推动锂价的上行）。因此我们认为，三季度发生新一轮涨价是大概率事件。

新能源发电行业，目前行业的增长仍然受制于硅料产能的释放。我们仍然预期在三四季度，硅料的供需矛盾会逐步缓解。目前情况下，我们观察到产业链部分环节的盈利能力兑现存在问题，因此并不倾向于硅料降价后，制造业环节的盈利将会上升。我们依然判断新能源发电的最大受益者可能是储能行业，将在适当的时候进行布局。

TMT行业，看好智能汽车。下半年我们预计，电动汽车行业仍然会受到锂资源的制约，一方面放量存在天花板，另一方面盈利会有压力。但从技术进步角度来看，由于dmi和增程式产品的进步，其在高油价和高锂价情况下充分受益，在今年二季度也出现了较大级别的行情。因此未来汽车行业，我们更关注产品的创新。并且由于在新能源汽车领域，目前不存在苹果这种给供应商留出丰厚利润的公司，我们认为整车环节好于零部件。

二季度是行情的开始，对于我们目前的表现，只能用中规中矩来形容。我们期待三季度的到来，也期待三季度会有好的成绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金A级份额净值为3.4709元，C级份额净值为3.4349元，本报告期A级份额净值增长率为1.88%，C级份额净值增长率为1.68%，同期业绩比较基准收益率为-4.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022年二季度，我们可以看到国内市场正在逐步走出奥密克戎的影响，需求在6月份开始恢复，并且预期在三季度经济进入加速的上行阶段，尤其是成长行业的增长将十分迅猛，所以我们判断国内的供需双强。而海外尤其是欧洲，陷入俄乌战争的泥潭，并在可以预见的未来都难以脱身。新变种的新冠病毒在海外开始新一轮的传播，也将对他们的经济造成影响，所以我们预计海外的供给和需求都趋弱。国内供需双强，

海外供需双弱，我们整个下半年的基本思路，由此展开。

在上个季度我们提到，传统能源在未来的较长时间内，可能都没有较大量的供给，因此全球经济增速的天花板被能源供应总量所束缚。考虑到二季度，国内经济受到阶段性冲击，而海外下半年存在衰退的可能，全年总量角度来看，能源约束的程度在一定时间内有所放松。在中国出台经济刺激政策的背景下，我们认为下半年国内经济增长将提速。因此我们主要看好来自于国内需求占比较大的行业。

供给上我们认为海外因为战争、疫情、能源等原因导致的供给失速，将使得来自于海外的供给会低于预期。对于供应主要来自于海外的环节，其国内的供应商很有可能受益。供需关系很可能好于上半年。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括估值委员会、运营部及相关部门。

本基金的日常估值程序通常由运营部估值核算岗执行并由业务复核岗复核估值结果，最终由估值核算员与产品托管人的估值结果核对一致。

本基金的特别估值程序由估值委员会秘书部门运营部在收到启动特殊估值程序的请求后，应通过估值核算人员及时与基金托管人沟通协商，必要时征求会计师事务所的专业意见，并将有关信息及材料一并报送全体估值委员会成员；估值委员会应综合考虑投资部门、研究部和运营部等各方面的意见和建议，并按照有关议事规则讨论审议，决定批准或不批准使用特殊估值调整；运营部应当根据经估值委员会审议通过的特别估值调整意见执行估值程序，准备特殊估值调整事项的临时公告，并发起信息披露审批流程；监察稽核部应当对特殊估值调整事项的相关信息披露进行合规审核。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金A类份额本期已实现收益为-495,222,363.32元，期末可供分配利润为907,467,249.00元。

本基金C类份额本期已实现收益为-438,325,222.05元，期末可供分配利润为679,116,921.21元。

本基金本报告期未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国投瑞银新能源混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“ 关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国投瑞银新能源混合型证券投资基金

报告截止日：2022年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末

		2022年6月30日	2021年12月31日
资产：		-	-
银行存款	6.4.8.1	543,435,575.08	522,280,542.83
结算备付金		1,879,486.31	9,284,817.97
存出保证金		1,021,085.27	2,163,317.81
交易性金融资产	6.4.8.2	8,659,321,407.41	7,351,175,946.41
其中：股票投资		8,538,858,075.90	7,351,175,946.41
基金投资		-	-
债券投资		120,463,331.51	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.8.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.8.4	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		19,008,208.86	1,286,933.92
应收股利		8,127,484.18	-
应收申购款		107,436,635.66	32,589,728.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.8.5	-	67,696.60
资产总计		9,340,229,882.77	7,918,848,984.36
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2022年6月30日**	**上年度末 2021年12月31日**
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.8.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	93.83
应付赎回款		230,565,087.85	126,487,803.58
应付管理人报酬		10,727,224.42	9,802,521.83
应付托管费		1,787,870.75	1,633,753.64
应付销售服务费		1,335,098.95	1,022,689.41
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.8.6	2,722,185.42	5,348,825.71
负债合计		247,137,467.39	144,295,688.00
净资产：		**-**	**-**

实收基金	6.4.8.7	2,631,777,239.17	2,289,805,699.96
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.8.8	6,461,315,176.21	5,484,747,596.40
净资产合计		9,093,092,415.38	7,774,553,296.36
负债和净资产总计		9,340,229,882.77	7,918,848,984.36

注：（1）报告截止日2022年06月30日，国投瑞银新能源混合A类基金份额净值人民币3.4709元，国投瑞银新能源混合C类基金份额净值人民币3.4349元。基金份额总额2,631,777,239.17份，其中国投瑞银新能源混合A类基金份额1,478,686,742.58份；国投瑞银新能源混合C类基金份额1,153,090,496.59份。

（2）以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：资产负债表中上年度末的“其他资产”项目包含“应收利息”项目余额，“其他负债”项目包含“应付交易费用”及“应付利息”项目余额。

6.2 利润表

会计主体：国投瑞银新能源混合型证券投资基金

本报告期：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年1月1日至 2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至 2021年6月30日
一、营业总收入		**294,518,493.11**	**144,059,737.42**
1.利息收入		1,029,305.06	136,463.84
其中：存款利息收入	6.4.8.9	1,029,305.06	136,145.50
债券利息收入		-	318.34
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-876,789,035.14	154,237,115.53
其中：股票投资收益	6.4.8.10	-912,868,295.54	152,081,218.50
基金投资收益	6.4.8.11	-	-
债券投资收益	6.4.8.12	4,716,285.00	82,185.93
资产支持证券投资收益	6.4.8.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.8.14	-	-
衍生工具收益	6.4.8.15	-	-
股利收益	6.4.8.16	31,362,975.40	2,073,711.10

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.8.17	1,154,806,669.24	-13,191,667.78
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.8.18	15,471,553.95	2,877,825.83
减：二、营业总支出		**73,259,409.24**	**11,024,816.83**
1．管理人报酬		56,686,703.13	6,440,395.38
2．托管费		9,447,783.95	1,073,399.23
3．销售服务费		6,966,738.76	765,375.34
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.8.19	-	-
7．税金及附加		27.24	0.14
8．其他费用	6.4.8.20	158,156.16	2,745,646.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**221,259,083.87**	**133,034,920.59**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**221,259,083.87**	**133,034,920.59**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		221,259,083.87	133,034,920.59

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银新能源混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目		本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	2,289,805,699.96	-	5,484,747,596.40	7,774,553,296.36
二、本期期初	2,289,805,699.96	-	5,484,747,596.40	7,774,553,29

净资产（基金净值）				6.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	341,971,539.21	-	976,567,579.81	1,318,539,119.02
（一）、综合收益总额	-	-	221,259,083.87	221,259,083.87
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	341,971,539.21	-	755,308,495.94	1,097,280,035.15
其中：1.基金申购款	2,535,426,221.25	-	5,131,090,361.93	7,666,516,583.18
2.基金赎回款	-2,193,454,682.04	-	-4,375,781,865.99	-6,569,236,548.03
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	2,631,777,239.17	-	6,461,315,176.21	9,093,092,415.38

项目		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日		
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	430,883,008.93	-	468,029,442.29	898,912,451.22
二、本期期初净资产（基金净值）	430,883,008.93	-	468,029,442.29	898,912,451.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-112,338,242.02	-	6,025,392.27	-106,312,849.75
（一）、综合	-	-	133,034,920.59	133,034,920.

收益总额				59
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-112,338,242.02	-	-127,009,528.32	-239,347,770.34
其中：1.基金申购款	395,468,592.52	-	452,839,333.63	848,307,926.15
2.基金赎回款	-507,806,834.54	-	-579,848,861.95	-1,087,655,696.49
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	318,544,766.91	-	474,054,834.56	792,599,601.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：王彦杰，主管会计工作负责人：王彦杰，会计机构负责人：冯伟

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国投瑞银新能源混合型证券投资基金 (以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]1154号文《关于准予国投瑞银新能源混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人国投瑞银基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2019年11月18日正式生效，首次设立募集规模为411,231,422.38份基金份额。

本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司，注册登记机构为国投瑞银基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票（包

括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金股票投资占基金资产的比例为60%–95%，其中，投资于本基金定义的新能源主题相关行业证券比例不低于非现金基金资产的80%，投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：中证新能源指数收益率×60%+恒生工业行业指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2022年6月30日的财务状况以及2022年中期的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 重要会计政策和会计估计

6.4.5.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1） 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2） 金融负债分类

除了由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.5.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基

金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.5.3 收入/(损失)的确认和计量

（1） 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用

情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2） 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入企业；3）股利的金额能够可靠计量。

（3） 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.6 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.6.1 会计政策变更的说明

新金融工具准则

根据《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》、《企业会计准则第37号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初留存收益。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金

的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日，原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币522,280,542.83元，自应收利息转入的重分类金额为人民币56,414.71元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币522,336,957.54元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币9,284,817.97元，自应收利息转入的重分类金额为人民币4,178.20元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币9,288,996.17元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币2,163,317.81元，自应收利息转入的重分类金额为人民币973.50元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币2,164,291.31元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币67,696.60元，转出至银行存款的重分类金额为人民币56,414.71元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币4,178.20元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币973.50元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币0.00元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币0.00元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币6,130.19元，转出至其他资产的重分类金额为人民币0.00元。经上述重分类后，应收利息不再作为

财务报表项目单独列报。

应收申购款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币32,589,728.82元，自应收利息转入的重分类金额为人民币6,130.19元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币32,595,859.01元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产及金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.6.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.6.3 差错更正的说明

无。

6.4.7 税项

（1）境内投资

（i）印花税

证券（股票）交易印花税税率为1‰，由出让方缴纳。

（ii）增值税及附加、企业所得税

自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业

务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（iii）个人所得税

个人所得税税率为20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

（2）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政

策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.8 重要财务报表项目的说明

6.4.8.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	543,435,575.08
等于：本金	543,390,861.85
加：应计利息	44,713.23
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	543,435,575.08

6.4.8.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		7,777,249,436.75	-	8,538,858,075.90	761,608,639.15
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	119,901,120.00	427,331.51	120,463,331.51	134,880.00
	合计	119,901,120.00	427,331.51	120,463,331.51	134,880.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	7,897,150,556.75	427,331.51	8,659,321,407.41	761,743,519.15

6.4.8.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.8.4 买入返售金融资产

无。

6.4.8.5 其他资产

无。

6.4.8.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	123,634.35
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,484,495.73
其中：交易所市场	2,483,595.73
银行间市场	900.00
应付利息	-
信息披露费	59,507.37
审计费用	54,547.97
合计	2,722,185.42

6.4.8.7 实收基金

国投瑞银新能源混合A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,378,423,635.64	1,378,423,635.64
本期申购	786,033,351.89	786,033,351.89
本期赎回（以“-”号填列）	-685,770,244.95	-685,770,244.95
本期末	1,478,686,742.58	1,478,686,742.58

国投瑞银新能源混合C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	911,382,064.32	911,382,064.32
本期申购	1,749,392,869.36	1,749,392,869.36
本期赎回（以“-”号填列）	-1,507,684,437.09	-1,507,684,437.09
本期末	1,153,090,496.59	1,153,090,496.59

注：本期申购包含基金转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

6.4.8.8 未分配利润

国投瑞银新能源混合A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,331,831,827.29	1,985,624,932.08	3,317,456,759.37
本期利润	-495,222,363.32	545,716,520.30	50,494,156.98
本期基金份额交易产生的变动数	70,857,785.03	214,896,785.72	285,754,570.75
其中：基金申购款	632,027,515.56	1,005,825,839.03	1,637,853,354.59
基金赎回款	-561,169,730.53	-790,929,053.31	-1,352,098,783.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	907,467,249.00	2,746,238,238.10	3,653,705,487.10

国投瑞银新能源混合C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	860,207,753.63	1,307,083,083.40	2,167,290,837.03
本期利润	-438,325,222.05	609,090,148.94	170,764,926.89
本期基金份额交易产生的变动数	257,234,389.63	212,319,535.56	469,553,925.19
其中：基金申购款	1,397,522,156.91	2,095,714,850.43	3,493,237,007.34
基金赎回款	-1,140,287,767.28	-1,883,395,314.87	-3,023,683,082.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	679,116,921.21	2,128,492,767.90	2,807,609,689.11

6.4.8.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	955,096.43
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	55,423.23
其他	18,785.40
合计	1,029,305.06

6.4.8.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	2,433,759,274.27
减：卖出股票成本总额	3,338,203,483.25
减：交易费用	8,424,086.56
买卖股票差价收入	-912,868,295.54

6.4.8.11 基金投资收益

无。

6.4.8.12 债券投资收益

6.4.8.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	834,670.78
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,881,614.22
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	4,716,285.00

6.4.8.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	216,855,791.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	212,266,363.42
减：应计利息总额	705,788.85
减：交易费用	2,025.42
买卖债券差价收入	3,881,614.22

6.4.8.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.8.14 贵金属投资收益

无。

6.4.8.15 衍生工具收益

无。

6.4.8.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	31,362,975.40
基金投资产生的股利收益	-
合计	31,362,975.40

6.4.8.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	1,154,806,669.24
——股票投资	1,154,671,789.24
——债券投资	134,880.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,154,806,669.24

6.4.8.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	15,299,996.98
基金转换费收入	171,556.97
合计	15,471,553.95

6.4.8.19 信用减值损失

无。

6.4.8.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	54,547.97
信息披露费	59,507.37
银行间账户维护费	3,000.00
其他	13,340.19
银行汇划费用	27,760.63
合计	158,156.16

6.4.9 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.9.1 或有事项

无。

6.4.9.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.10 关联方关系

6.4.10.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期无与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.10.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国投瑞银基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司（"安信证券"）	与基金管理人受同一实际控制的公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.11 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.11.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.11.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
安信证券	204,511,130.00	3.54%	15,639,954.66	0.97%

6.4.11.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
安信证券	-	-	600,060.00	41.98%

6.4.11.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
安信证券	190,465.35	3.55%	119,945.04	4.83%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
安信证券	14,565.49	0.98%	1,157.33	0.21%

注：1.上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示，其中债券、回购及权证交易不计佣金。

2.该类席位租用协议服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.11.2 关联方报酬

6.4.11.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	56,686,703.13	6,440,395.38

其中：支付销售机构的客户维护费	23,530,318.88	2,003,996.59

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.50%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.11.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,447,783.95	1,073,399.23

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.11.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国投瑞银新能源混合A	国投瑞银新能源混合C	合计
中国银行	-	646,782.83	646,782.83
国投瑞银基金管理有限公司	-	352,434.85	352,434.85
安信证券	-	4,223.17	4,223.17
合计	-	1,003,440.85	1,003,440.85
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国投瑞银新能源混合A	国投瑞银新能源混合C	合计
国投瑞银基金管理有限公司	-	324,794.04	324,794.04

中国银行	-	32,163.33	32,163.33
安信证券	-	191.56	191.56
合计	-	357,148.93	357,148.93

注：销售服务费每日计提，按月支付。本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%，销售服务费计提的计算公式如下：

H＝E×C类基金份额的销售服务费年费率/当年天数

H为每日C类基金份额应计提的销售服务费

E为前一日C类基金份额的基金资产净值

6.4.11.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.11.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.11.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.11.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.11.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	543,435,575.08	955,096.43	48,661,161.43	111,387.32

6.4.11.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.11.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.12 利润分配情况

无。

6.4.13 期末（2022年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.13.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.13.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月	新股流通受限	55.57	30.03	635.00	35,286.95	19,069.05	-
301097	天益医疗	2022-03-25	6个月	新股流通受限	52.37	47.83	249.00	13,040.13	11,909.67	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6个月	新股流通受限	42.50	32.02	507.00	16,575.00	16,234.14	-
301110	青木股份	2022-03-04	6个月	新股流通受限	63.10	39.85	202.00	12,746.20	8,049.70	-
301116	益客食品	2022-01-10	6个月	新股流通受限	11.40	20.46	577.00	6,577.80	11,805.42	-
301120	新特电气	2022-04-11	6个月	新股流通受限	13.73	15.49	1,032.00	14,169.36	15,985.68	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月	新股流通受限	37.23	25.39	656.00	24,422.88	16,655.84	-
301125	腾亚精工	2022-05-27	6个月	新股流通受限	22.49	27.42	327.00	7,354.23	8,966.34	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6个月	新股流通受限	31.98	26.26	338.00	10,809.24	8,875.88	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	6个月	新股流通受限	15.37	15.99	644.00	9,898.28	10,297.56	-
301150	中一科技	2022-04-14	6个月	新股流通受限	163.56	82.76	403.00	43,997.64	33,352.28	-
301151	冠龙节能	2022-03-30	6个月	新股流通受限	30.82	21.46	703.00	21,666.46	15,086.38	-
301153	中科江南	2022-05-10	6个月	新股流通受限	33.68	43.98	398.00	13,404.64	17,504.04	-

301158	德石股份	2022-01-07	6个月	新股流通受限	15.64	20.38	379.00	5,927.56	7,724.02	-
301160	翔楼新材	2022-05-25	6个月	新股流通受限	31.56	37.66	392.00	12,371.52	14,762.72	-
301162	国能日新	2022-04-19	6个月	新股流通受限	45.13	54.11	334.00	15,073.42	18,072.74	-
301181	标榜股份	2022-02-11	6个月	新股流通受限	40.25	30.59	257.00	10,344.25	7,861.63	-
301187	欧圣电气	2022-04-13	6个月	新股流通受限	21.33	22.54	876.00	18,685.08	19,745.04	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	271.00	17,365.68	10,167.92	-
301200	大族数控	2022-02-18	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	857.00	65,611.92	44,495.44	-
301201	诚达药业	2022-01-12	6个月	新股流通受限	72.69	71.54	353.00	25,659.57	25,253.62	-
301206	三元生物	2022-01-26	6个月	新股流通受限	109.30	45.69	945.00	68,859.00	43,177.05	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	569.00	32,364.72	32,102.98	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6个月	新股流通受限	29.67	33.28	416.00	12,342.72	13,844.48	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6个月	新股流通受限	3.80	6.39	4,743.00	18,023.40	30,307.77	-
301216	万凯新材	2022-03-21	6个月	新股流通受限	35.68	29.84	1,120.00	39,961.60	33,420.80	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6个月	新股流通受限	17.27	14.83	4,284.00	73,984.68	63,531.72	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月	新股流通	173.98	87.82	578.00	55,847.58	50,759.96	-

				受限						
301220	亚香股份	2022-06-15	6个月	新股流通受限	35.98	39.15	285.00	10,254.30	11,157.75	-
301222	浙江恒威	2022-03-02	6个月	新股流通受限	33.98	28.96	332.00	11,281.36	9,614.72	-
301235	华康医疗	2022-01-21	6个月	新股流通受限	39.30	37.93	418.00	16,427.40	15,854.74	-
301236	软通动力	2022-03-08	6个月	新股流通受限	72.88	31.38	2,076.00	100,865.92	65,144.88	-
301237	和顺科技	2022-03-16	6个月	新股流通受限	56.69	41.86	261.00	14,796.09	10,925.46	-
301238	瑞泰新材	2022-06-10	6个月	新股流通受限	19.18	32.07	3,497.00	67,072.46	112,148.79	-
301248	杰创智能	2022-04-13	6个月	新股流通受限	39.07	29.87	472.00	18,441.04	14,098.64	-
301256	华融化学	2022-03-14	6个月	新股流通受限	8.05	10.08	1,831.00	14,739.55	18,456.48	-
301258	富士莱	2022-03-21	6个月	新股流通受限	48.30	41.68	295.00	14,248.50	12,295.60	-
301266	宇邦新材	2022-05-30	6个月	新股流通受限	26.86	47.07	517.00	13,886.62	24,335.19	-
301268	铭利达	2022-03-29	6个月	新股流通受限	28.50	34.87	641.00	18,268.50	22,351.67	-
301279	金道科技	2022-04-06	6个月	新股流通受限	31.20	22.81	296.00	9,235.20	6,751.76	-
301286	侨源股份	2022-06-06	6个月	新股流通受限	16.91	19.79	784.00	13,257.44	15,515.36	-
301288	清研环境	2022-04-14	6个月	新股流通受限	19.09	19.98	452.00	8,628.68	9,030.96	-
30129	东利	2022-	6个	新股	12.68	20.83	634.0	8,039.	13,20	-

8	机械	05-27	月	流通受限			0	12	6.22	
301302	华如科技	2022-06-16	6个月	新股流通受限	52.03	56.42	466.00	24,245.98	26,291.72	-
600938	中国海油	2022-04-14	6个月	新股流通受限	10.80	15.86	84,004.00	907,243.20	1,332,303.44	-
688115	思林杰	2022-03-07	6个月	新股流通受限	65.65	38.46	2,153.00	141,344.45	82,804.38	-
688120	华海清科	2022-05-30	6个月	新股流通受限	136.66	217.12	4,822.00	658,974.52	1,046,952.64	-
688175	高凌信息	2022-03-08	6个月	新股流通受限	51.68	32.23	2,851.00	147,339.68	91,887.73	-
688193	仁度生物	2022-03-23	6个月	新股流通受限	72.65	51.57	1,635.00	118,782.75	84,316.95	-
688220	翱捷科技	2022-01-06	6个月	新股流通受限	164.54	68.59	12,371.00	2,035,524.34	848,526.89	-
688262	国芯科技	2021-12-28	6个月	新股流通受限	41.98	47.75	7,129.00	299,275.42	340,409.75	-
688283	坤恒顺维	2022-02-08	6个月	新股流通受限	33.80	45.41	1,595.00	53,911.00	72,428.95	-
688327	云从科技	2022-05-20	6个月	新股流通受限	15.37	21.60	88,678.00	1,362,980.86	1,915,444.80	-
301139	元道通信	2022-06-30	1个月内	新股未上市	38.46	38.46	5,651.00	217,337.46	217,337.46	-
301175	中科环保	2022-06-30	1个月内	新股未上市	3.82	3.82	63,694.00	243,311.08	243,311.08	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	1个月内	新股未上市	41.52	41.52	1,576.00	65,435.52	65,435.52	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	1个月内	新股未上市	33.65	33.65	5,747.00	193,386.55	193,386.55	-

688237	超卓航科	2022-06-24	1个月内	新股未上市	41.27	41.27	2,891.00	119,311.57	119,311.57	-
688322	奥比中光	2022-06-30	1个月内	新股未上市	30.99	30.99	8,529.00	264,313.71	264,313.71	-
688400	凌云光	2022-06-27	1个月内	新股未上市	21.93	21.93	13,111.00	287,524.23	287,524.23	-

6.4.13.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.13.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.13.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.13.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.14 金融工具风险及管理

6.4.14.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金在日常经营活动面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制上述风险，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金管理人秉承全面风险控制的理念，将风险管理融入业务中，使风险控制与投资业务紧密结合，在董事会专业委员会监督管理下，建立了由督察长、合规与风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部、相关职能部门和业务部门构成的立体式风险管理架构体系。

6.4.14.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存

放在基金管理人制定的银行可投资名单内的已进行充分内部研究的信用等级较高的商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过对单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

于2022年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.00%（2021年12月31日：0.00%）。

6.4.14.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	120,463,331.51	-
合计	120,463,331.51	-

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级部分一般为国债、政策性金融债、短期融资券、超短期融资券和中期票据。

6.4.14.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.14.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.14.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.14.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.14.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.14.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产

超出基金持有的现金类资产规模，另一方面来自于基金持有的投资品种交易不活跃而带来的变现困难或不能以合理的价格变现。

6.4.14.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本报告期末，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.14.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.14.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人执行灵活的利率管理策略，借鉴瑞银全球资产管理公司海外管理经验，结合自主开发的估值系统管理利率风险，通过收益率利差分析、静态利差

分析和期权调整利差等分析，计算组合证券的修正久期、利差久期、有效久期和有效凸性的风险控制指标，跟踪调整投资组合的久期和凸性等利率风险衡量指标，控制组合的利率风险。当预期债券市场利率下降时，加大固定利率证券的配置比例；当预期债券市场利率上升时，加大浮息证券的配置比例。通过改变浮息和固息证券的配置比例，控制证券投资组合的久期，防范利率风险。

6.4.14.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	543,390,861.85	-	-	44,713.23	543,435,575.08
结算备付金	1,876,996.17	-	-	2,490.14	1,879,486.31
存出保证金	1,020,613.80	-	-	471.47	1,021,085.27
交易性金融资产	120,036,000.00	-	-	8,539,285,407.41	8,659,321,407.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	19,008,208.86	19,008,208.86
应收股利	-	-	-	8,127,484.18	8,127,484.18
应收申购款	-	-	-	107,436,635.66	107,436,635.66
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	666,324,471.82	-	-	8,673,905,410.95	9,340,229,882.77
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	230,565,087.85	230,565,087.85
应付管理人报酬	-	-	-	10,727,224.42	10,727,224.42
应付托管费	-	-	-	1,787,870.75	1,787,870.75

应付销售服务费	-	-	-	1,335,098.95	1,335,098.95
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,722,185.42	2,722,185.42
负债总计	-	-	-	247,137,467.39	247,137,467.39
利率敏感度缺口	666,324,471.82	-	-	8,426,767,943.56	9,093,092,415.38
上年度末 2021年12月31日	**1年以内**	**1-5年**	**5年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
银行存款	522,280,542.83	-	-	-	522,280,542.83
结算备付金	9,284,817.97	-	-	-	9,284,817.97
存出保证金	2,163,317.81	-	-	-	2,163,317.81
交易性金融资产	-	-	-	7,351,175,946.41	7,351,175,946.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,286,933.92	1,286,933.92
应收利息	-	-	-	67,696.60	67,696.60
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	32,589,728.82	32,589,728.82
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	533,728,678.61	-	-	7,385,120,305.75	7,918,848,984.36
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融	-	-	-	-	-

资产款					
应付证券清算款	-	-	-	93.83	93.83
应付赎回款	-	-	-	126,487,803.58	126,487,803.58
应付管理人报酬	-	-	-	9,802,521.83	9,802,521.83
应付托管费	-	-	-	1,633,753.64	1,633,753.64
应付销售服务费	-	-	-	1,022,689.41	1,022,689.41
应付交易费用	-	-	-	5,070,068.04	5,070,068.04
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	278,757.67	278,757.67
负债总计	-	-	-	144,295,688.00	144,295,688.00
利率敏感度缺口	533,728,678.61	-	-	7,240,824,617.75	7,774,553,296.36

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.14.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为1.32%（2021年12月31日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020年12月31日：同）。

6.4.14.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金资产净值产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

6.4.14.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	233,576,796.63	233,576,796.63
资产合计	**-**	**233,576,796.63**	**233,576,796.63**
以外币计价的负债			
负债合计	**-**	**-**	**-**
资产负债表外汇风险敞口净额	**-**	**233,576,796.63**	**233,576,796.63**
项目	**上年度末 2021年12月31日**		
	美元 折合人民币	**港币 折合人民币**	**合计**
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	416,593,902.84	416,593,902.84
资产合计	**-**	**416,593,902.84**	**416,593,902.84**
以外币计价的负债			
负债合计	**-**	**-**	**-**
资产负债表外汇风险敞口净额	**-**	**416,593,902.84**	**416,593,902.84**

6.4.14.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	所有外币相对人民币升值5%	11,678,839.83	20,829,695.14
	所有外币相对人民币贬值5%	-11,678,839.83	-20,829,695.14

6.4.14.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所

上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，通过投资组合的分散化等方式，来主动应对可能发生的其他价格风险。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.14.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	8,538,858,075.90	93.90	7,351,175,946.41	94.55
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	120,463,331.51	1.32	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	8,659,321,407.4	95.23	7,351,175,946.4	94.55

	1		1	

6.4.14.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	基金业绩比较基准上升5%	578,834,028.15	511,977,152.88
	基金业绩比较基准下降5%	-578,834,028.15	-511,977,152.88

注：中证新能源指数收益率×60%+恒生工业行业指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合指数收益率×20%。

6.4.15 公允价值

6.4.15.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.15.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.15.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	8,530,656,180.44	7,346,178,483.95
第二层次	121,853,951.63	4,997,462.46
第三层次	6,811,275.34	-
合计	8,659,321,407.41	7,351,175,946.41

6.4.15.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.16 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	8,538,858,075.90	91.42
	其中：股票	8,538,858,075.90	91.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	120,463,331.51	1.29
	其中：债券	120,463,331.51	1.29
	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	545,315,061.39	5.84
8	其他各项资产	135,593,413.97	1.45
9	合计	9,340,229,882.77	100.00

注：1、截止本报告期末，基金资产通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币233,576,796.63元，占基金总净值比例2.57%。

2、本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”，“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额，下同。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	14,690.97	0.00
B	采矿业	1,557,577,867.33	17.13
C	制造业	6,696,524,960.06	73.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,815.92	0.00
E	建筑业	9,987.18	0.00
F	批发和零售业	87,845.56	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	13,518.40	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,651,676.07	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	47,818,598.00	0.53
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	70,336.83	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	281,347.52	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,620.69	0.00
R	文化、体育和娱乐业	12,014.74	0.00
S	综合	-	-
	合计	8,305,281,279.27	91.34

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
材料	233,513,837.03	2.57
公用事业	21,568.40	0.00
必需消费品	41,391.20	0.00
合计	233,576,796.63	2.57

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002466	天齐锂业	7,165,046.00	894,197,740.80	9.83
2	002756	永兴材料	5,717,074.00	870,195,833.54	9.57
3	002176	江特电机	31,852,790.00	797,593,861.60	8.77
4	600499	科达制造	35,372,241.00	730,083,054.24	8.03
5	002192	融捷股份	4,358,112.00	669,841,814.40	7.37
6	603799	华友钴业	6,832,894.00	653,361,324.28	7.19
7	002738	中矿资源	5,880,494.00	544,592,549.34	5.99
8	000762	西藏矿业	9,183,003.00	513,605,357.79	5.65
9	002240	盛新锂能	7,434,757.00	448,761,932.52	4.94
10	000408	藏格矿业	13,043,095.00	429,639,549.30	4.72
11	000792	盐湖股份	14,076,045.00	421,718,308.20	4.64
12	600338	西藏珠峰	12,989,491.00	372,798,391.70	4.10
13	600111	北方稀土	9,995,798.00	351,452,257.68	3.87
14	H00189	东岳集团	27,806,000.00	233,513,837.03	2.57
15	300390	天华超净	1,934,740.00	169,096,276.00	1.86
16	002460	赣锋锂业	816,448.00	121,405,817.60	1.34
17	300772	运达股份	3,681,621.00	93,660,438.24	1.03
18	002006	精功科技	2,474,100.00	73,554,993.00	0.81
19	600438	通威股份	849,200.00	50,833,112.00	0.56
20	600773	西藏城投	2,427,340.00	47,818,598.00	0.53
21	300014	亿纬锂能	248,933.00	24,270,967.50	0.27
22	300124	汇川技术	269,058.00	17,722,850.46	0.19
23	688327	云从科技	88,678.00	1,915,444.80	0.02
24	600938	中国海油	84,004.00	1,332,303.44	0.01
25	688120	华海清科	4,822.00	1,046,952.64	0.01
26	688220	翱捷科技	12,371.00	848,526.89	0.01
27	688262	国芯科技	7,129.00	340,409.75	0.00
28	688400	凌 云 光	13,111.00	287,524.23	0.00
29	688322	奥比中光	8,529.00	264,313.71	0.00
30	301175	中科环保	63,694.00	243,311.08	0.00
31	301139	元道通信	5,651.00	217,337.46	0.00
32	301239	普瑞眼科	5,747.00	193,386.55	0.00
33	688237	超卓航科	2,891.00	119,311.57	0.00
34	301238	瑞泰新材	3,497.00	112,148.79	0.00
35	688175	高凌信息	2,851.00	91,887.73	0.00
36	688193	仁度生物	1,635.00	84,316.95	0.00
37	688115	思 林 杰	2,153.00	82,804.38	0.00
38	688283	坤恒顺维	1,595.00	72,428.95	0.00
39	301233	盛帮股份	1,576.00	65,435.52	0.00
40	301236	软通动力	2,076.00	65,144.88	0.00

41	301217	铜冠铜箔	4,284.00	63,531.72	0.00
42	301219	腾远钴业	578.00	50,759.96	0.00
43	301200	大族数控	857.00	44,495.44	0.00
44	301206	三元生物	945.00	43,177.05	0.00
45	H06969	思摩尔国际	2,000.00	41,391.20	0.00
46	601089	福元医药	1,749.00	36,816.45	0.00
47	301216	万凯新材	1,120.00	33,420.80	0.00
48	301150	中一科技	403.00	33,352.28	0.00
49	301207	华兰疫苗	569.00	32,102.98	0.00
50	301215	中汽股份	4,743.00	30,307.77	0.00
51	301302	华如科技	466.00	26,291.72	0.00
52	301201	诚达药业	353.00	25,253.62	0.00
53	301266	宇邦新材	517.00	24,335.19	0.00
54	301268	铭 利 达	641.00	22,351.67	0.00
55	301187	欧圣电气	876.00	19,745.04	0.00
56	300834	星辉环材	635.00	19,069.05	0.00
57	301256	华融化学	1,831.00	18,456.48	0.00
58	301162	国能日新	334.00	18,072.74	0.00
59	301153	中科江南	398.00	17,504.04	0.00
60	301123	奕东电子	656.00	16,655.84	0.00
61	301103	何氏眼科	507.00	16,234.14	0.00
62	603070	万控智造	775.00	16,197.50	0.00
63	301120	新特电气	1,032.00	15,985.68	0.00
64	301235	华康医疗	418.00	15,854.74	0.00
65	301286	侨源股份	784.00	15,515.36	0.00
66	001313	粤海饲料	1,232.00	15,104.32	0.00
67	301151	冠龙节能	703.00	15,086.38	0.00
68	301166	优 宁 维	253.00	14,891.58	0.00
69	301168	通灵股份	329.00	14,831.32	0.00
70	301160	翔楼新材	392.00	14,762.72	0.00
71	301189	奥尼电子	435.00	14,489.85	0.00
72	301248	杰创智能	472.00	14,098.64	0.00
73	301093	华兰股份	409.00	13,861.01	0.00
74	301212	联盛化学	416.00	13,844.48	0.00
75	301180	万祥科技	654.00	13,701.30	0.00
76	301190	善水科技	575.00	13,644.75	0.00
77	603097	江苏华辰	577.00	13,617.20	0.00
78	301118	恒光股份	315.00	13,554.45	0.00
79	603209	兴通股份	595.00	13,518.40	0.00
80	301298	东利机械	634.00	13,206.22	0.00
81	301088	戎美股份	704.00	13,136.64	0.00
82	301100	风光股份	599.00	12,926.42	0.00

83	H00916	龙源电力	990.00	12,835.03	0.00
84	001266	宏英智能	247.00	12,298.13	0.00
85	301258	富 士 莱	295.00	12,295.60	0.00
86	603215	比依股份	575.00	12,115.25	0.00
87	301179	泽宇智能	295.00	12,038.95	0.00
88	301097	天益医疗	249.00	11,909.67	0.00
89	301116	益客食品	577.00	11,805.42	0.00
90	301126	达嘉维康	662.00	11,340.06	0.00
91	001268	联合精密	409.00	11,337.48	0.00
92	301220	亚香股份	285.00	11,157.75	0.00
93	301078	孩 子 王	756.00	11,082.96	0.00
94	301108	洁雅股份	280.00	11,079.60	0.00
95	301237	和顺科技	261.00	10,925.46	0.00
96	301185	鸥玛软件	578.00	10,687.22	0.00
97	605599	菜百股份	980.00	10,662.40	0.00
98	603219	富佳股份	528.00	10,517.76	0.00
99	301111	粤万年青	379.00	10,392.18	0.00
100	301137	哈焊华通	644.00	10,297.56	0.00
101	301017	漱玉平民	555.00	10,289.70	0.00
102	301196	唯科科技	271.00	10,167.92	0.00
103	301092	争光股份	323.00	10,161.58	0.00
104	301046	能辉科技	290.00	10,036.90	0.00
105	605598	上海港湾	553.00	9,987.18	0.00
106	301015	百洋医药	462.00	9,969.96	0.00
107	605566	福莱蒽特	435.00	9,926.70	0.00
108	001296	长江材料	403.00	9,905.74	0.00
109	605567	春雪食品	629.00	9,850.14	0.00
110	605033	美邦股份	423.00	9,809.37	0.00
111	603272	联翔股份	443.00	9,723.85	0.00
112	301222	浙江恒威	332.00	9,614.72	0.00
113	301020	密封科技	421.00	9,472.50	0.00
114	605069	正和生态	608.00	9,326.72	0.00
115	301048	金鹰重工	843.00	9,281.43	0.00
116	603048	浙江黎明	464.00	9,224.32	0.00
117	300967	晓鸣股份	507.00	9,131.07	0.00
118	301288	清研环境	452.00	9,030.96	0.00
119	605138	盛泰集团	723.00	9,023.04	0.00
120	001234	泰 慕 士	333.00	9,017.64	0.00
121	301125	腾亚精工	327.00	8,966.34	0.00
122	300774	倍 杰 特	444.00	8,951.04	0.00
123	301135	瑞德智能	338.00	8,875.88	0.00
124	605580	恒盛能源	654.00	8,815.92	0.00
125	301021	英诺激光	290.00	8,758.00	0.00

126	300962	中金辐照	576.00	8,697.60	0.00
127	300966	共同药业	286.00	8,537.10	0.00
128	001288	运机集团	537.00	8,382.57	0.00
129	001219	青岛食品	353.00	8,066.05	0.00
130	301193	家联科技	297.00	8,063.55	0.00
131	301110	青木股份	202.00	8,049.70	0.00
132	301133	金钟股份	286.00	7,942.22	0.00
133	301181	标榜股份	257.00	7,861.63	0.00
134	300978	东箭科技	593.00	7,738.65	0.00
135	301158	德石股份	379.00	7,724.02	0.00
136	301198	喜悦智行	340.00	7,667.00	0.00
137	301026	浩通科技	203.00	7,486.64	0.00
138	603150	万朗磁塑	250.00	7,442.50	0.00
139	301004	嘉益股份	312.00	7,381.92	0.00
140	301038	深水规院	346.00	7,193.34	0.00
141	301182	凯旺科技	294.00	6,985.44	0.00
142	301012	扬电科技	170.00	6,971.70	0.00
143	301027	华蓝集团	286.00	6,944.08	0.00
144	H00836	华润电力	501.00	6,940.89	0.00
145	301066	万 事 利	482.00	6,873.32	0.00
146	601865	福 莱 特	179.00	6,819.90	0.00
147	301279	金道科技	296.00	6,751.76	0.00
148	300956	英力股份	371.00	6,729.94	0.00
149	605577	龙版传媒	588.00	6,703.20	0.00
150	300987	川网传媒	391.00	6,596.17	0.00
151	301002	崧盛股份	261.00	6,491.07	0.00
152	300975	商络电子	738.00	6,472.26	0.00
153	301055	张 小 泉	355.00	6,311.90	0.00
154	300998	宁波方正	201.00	6,080.25	0.00
155	301081	严牌股份	403.00	6,077.24	0.00
156	300971	博亚精工	245.00	6,039.25	0.00
157	300814	中富电路	328.00	6,002.40	0.00
158	300943	春晖智控	382.00	6,001.22	0.00
159	300958	建工修复	300.00	5,934.00	0.00
160	301083	百胜智能	416.00	5,807.36	0.00
161	301011	华立科技	175.00	5,755.75	0.00
162	301030	仕净科技	242.00	5,643.44	0.00
163	300972	万辰生物	430.00	5,559.90	0.00
164	688696	极米科技	18.00	5,541.66	0.00
165	301010	晶雪节能	218.00	5,526.30	0.00
166	300950	德 固 特	328.00	5,346.40	0.00
167	301025	读客文化	403.00	5,311.54	0.00
168	301057	汇隆新材	218.00	5,308.30	0.00

169	300948	冠中生态	324.00	5,141.88	0.00
170	301016	雷 尔 伟	275.00	5,128.75	0.00
171	688707	振华新材	66.00	4,994.22	0.00
172	301032	新柴股份	513.00	4,770.90	0.00
173	301049	超越科技	196.00	4,647.16	0.00
174	301036	双乐股份	205.00	4,608.40	0.00
175	301007	德 迈 仕	303.00	4,566.21	0.00
176	301033	迈普医学	108.00	4,547.88	0.00
177	301059	金 三 江	259.00	4,351.20	0.00
178	300992	泰福泵业	200.00	4,262.00	0.00
179	301041	金 百 泽	215.00	4,237.65	0.00
180	301037	保 立 佳	193.00	4,215.12	0.00
181	300995	奇德新材	191.00	4,087.40	0.00
182	002009	天奇股份	219.00	4,051.50	0.00
183	300854	中兰环保	203.00	4,035.64	0.00
184	301053	远信工业	155.00	3,620.80	0.00
185	688728	格 科 微	173.00	3,548.23	0.00
186	301068	大地海洋	144.00	3,477.60	0.00
187	301079	邵阳液压	140.00	3,472.00	0.00
188	688772	珠海冠宇	110.00	3,377.00	0.00
189	H00956	新天绿色能源	524.00	1,792.48	0.00
190	688187	时代电气	3.00	194.97	0.00
191	688779	长远锂科	4.00	80.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600499	科达制造	593,441,753.57	7.63
2	603799	华友钴业	385,139,471.58	4.95
3	002738	中矿资源	375,183,660.62	4.83
4	000408	藏格矿业	374,013,140.30	4.81
5	600338	西藏珠峰	342,869,012.65	4.41
6	000792	盐湖股份	196,276,782.69	2.52
7	002240	盛新锂能	134,857,828.08	1.73
8	002466	天齐锂业	134,746,643.26	1.73
9	000762	西藏矿业	126,627,631.48	1.63
10	600111	北方稀土	118,652,153.20	1.53
11	603260	合盛硅业	116,750,963.96	1.50

12	601168	西部矿业	79,054,673.70	1.02
13	600773	西藏城投	49,729,726.19	0.64
14	002756	永兴材料	49,614,577.36	0.64
15	600438	通威股份	42,805,492.25	0.55
16	002171	楚江新材	35,298,371.23	0.45
17	300487	蓝晓科技	29,761,566.00	0.38
18	300709	精研科技	25,346,718.84	0.33
19	300390	天华超净	24,780,150.02	0.32
20	688599	天合光能	23,784,554.08	0.31

注："买入金额"按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603260	合盛硅业	523,295,273.42	6.73
2	600596	新安股份	246,340,067.19	3.17
3	300343	联创股份	181,695,319.32	2.34
4	300655	晶瑞电材	172,004,418.10	2.21
5	600673	东阳光	147,691,442.38	1.90
6	002466	天齐锂业	118,137,301.75	1.52
7	H00189	东岳集团	116,365,977.75	1.50
8	002009	天奇股份	111,219,511.59	1.43
9	601865	福莱特	84,659,971.65	1.09
10	000831	五矿稀土	67,484,290.56	0.87
11	002756	永兴材料	64,579,512.00	0.83
12	603688	石英股份	62,058,253.35	0.80
13	601168	西部矿业	61,750,012.70	0.79
14	600163	中闽能源	48,969,840.40	0.63
15	601778	晶科科技	38,964,819.00	0.50
16	688599	天合光能	28,845,773.81	0.37
17	002487	大金重工	28,820,045.60	0.37
18	603985	恒润股份	27,200,341.00	0.35
19	300443	金雷股份	26,628,479.22	0.34
20	600522	中天科技	25,613,880.35	0.33

注："卖出金额"按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	3,371,213,823.50
卖出股票的收入（成交）总额	2,433,759,274.27

注："买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	120,463,331.51	1.32
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	120,463,331.51	1.32

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	220009	22附息国债09	1,200,000	120,463,331.51	1.32

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 基金投资股指期货的投资政策

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券中，持有“江特电机”，江西特种电机股份有限公司（以下简称“公司”）于2021年12月9日收到了中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《立案告知书》（证监立案 字0252021009号），公司因涉嫌信息披露违法违规，根据《中华人民共和国证券法》、 《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，中国证监会决定对公司立案。基金管理人认为，上述公司被处罚事项有利于上述公司加强内部管理，上述公司当前总体生产经营和财务状况保持稳定，事件对上述公司经营活动未产生实质性影响，不改变上述公司基本面。本基金对上述证券的投资严格执行了基金管理人规定的投资决策程序。
除上述情况外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。
7.12.2 本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选库的情况。
7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,021,085.27
2	应收清算款	19,008,208.86
3	应收股利	8,127,484.18
4	应收利息	-
5	应收申购款	107,436,635.66

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	135,593,413.97

7.12.4 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处于转股期的可转债。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票投资中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国投瑞银新能源混合A	208,236	7,101.01	109,343,946.12	7.39%	1,369,342,796.46	92.61%
国投瑞银新能源混合C	237,325	4,858.70	202,408,766.19	17.55%	950,681,730.40	82.45%
合计	445,561	5,906.66	311,752,712.31	11.85%	2,320,024,526.86	88.15%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数	占基金总份额比例

		（份）	
基金管理人所有从业人员持有本基金	国投瑞银新能源混合A	2,483,275.91	0.17%
	国投瑞银新能源混合C	78,040.85	0.01%
	合计	2,561,316.76	0.10%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国投瑞银新能源混合A	0~10
	国投瑞银新能源混合C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国投瑞银新能源混合A	50~100
	国投瑞银新能源混合C	0
	合计	50~100

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国投瑞银新能源混合A	国投瑞银新能源混合C
基金合同生效日（2019年11月18日）基金份额总额	392,034,693.11	19,196,729.27
本报告期期初基金份额总额	1,378,423,635.64	911,382,064.32
本报告期基金总申购份额	786,033,351.89	1,749,392,869.36
减：本报告期基金总赎回份额	685,770,244.95	1,507,684,437.09
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,478,686,742.58	1,153,090,496.59

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

1、自2022年3月14日起，王书鹏先生不再担任公司副总经理。

2、自2022年4月28日起，汪斌先生担任公司副总经理兼财务负责人。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金基金投资策略未发生变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金继续聘请安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务，未发生改聘会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	1	708,161,663.99	12.26%	659,501.94	12.29%	-
东北证券	2	605,825,263.18	10.49%	548,927.97	10.23%	-
信达证券	1	498,145,708.72	8.62%	463,926.01	8.65%	-
东方证券	3	459,270,262.63	7.95%	427,712.01	7.97%	-
东方财富	1	398,151,126.96	6.89%	370,800.49	6.91%	-
天风证券	1	385,437,470.76	6.67%	358,959.59	6.69%	-
开源证券	1	345,347,645.26	5.98%	321,625.62	6.00%	-
申万宏源证券	1	332,185,195.76	5.75%	309,365.34	5.77%	-
中信证券	2	330,164,265.14	5.72%	307,479.60	5.73%	-
广发证券	1	327,259,081.89	5.67%	304,777.85	5.68%	-
中信建投证券	2	324,712,849.57	5.62%	302,395.26	5.64%	-
东兴证券	1	241,758,898.34	4.19%	225,146.89	4.20%	-

安信证券	1	204,511,130.00	3.54%	190,465.35	3.55%	-
中泰证券	3	170,699,140.58	2.96%	158,971.24	2.96%	-
东亚前海	1	140,270,910.37	2.43%	130,634.32	2.44%	-
太平洋证券	1	134,337,682.93	2.33%	125,109.43	2.33%	-
华西证券	2	128,525,125.88	2.23%	119,688.65	2.23%	-
中金公司	1	41,520,925.46	0.72%	38,667.93	0.72%	-
野村东方	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
中信华南证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	20,022,039.30	76.89%	-	-	-	-

中信建投证券	6,016,592.20	23.11%	-	-	-	-

注：1、本基金管理人在租用证券机构交易单元上符合中国证监会的有关规定。本基金管理人将证券经营机构的注册资本、研究水平、财务状况、经营状况、经营行为以及通讯交易条件作为基金专用交易单元的选择标准，由研究部、投资部及交易部对券商进行考评并提出交易单元租用及更换方案。根据董事会授权，由公司执行委员会批准。

2、本基金报告期内租用证券公司交易单元未发生变更。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	报告期内基金管理人发布了关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告。	上海证券报、中国证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	报告期内基金管理人发布了高级管理人员变更的公告。	证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-15
3	报告期内基金管理人发布了关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告。	上海证券报、中国证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-15
4	报告期内基金管理人发布了关于旗下部分公募基金产品风险等级变更的公告。	中国证监会基金电子披露网站	2022-04-26
5	报告期内基金管理人发布了高级管理人员变更的公告。	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-30
6	报告期内基金管理人发布了本基金恢复大额转换转出业务的公告。	上海证券报，中国证监会基金电子披露网	2022-06-15

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

产品特有风险
投资者应关注本基金单一投资者持有份额比例过高时，可能出现以下风险： 1、赎回申请延期办理的风险

单一投资者大额赎回时易触发本基金巨额赎回的条件，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要部分延期办理的风险。
2、基金净值大幅波动的风险
单一投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；单一投资者大额赎回时，相应的赎回费归入基金资产以及赎回时的份额净值的精度问题均可能引起基金份额净值出现较大波动。
3、基金投资策略难以实现的风险
单一投资者大额赎回后，可能使基金资产净值显著降低，从而使基金在拟参与银行间市场交易等投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。
4、基金财产清算的风险
根据本基金基金合同的约定，基金合同生效后的存续期内，若连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金合同将终止，并根据基金合同的约定进行基金财产清算。单一投资者大额赎回后，可能造成基金资产净值大幅缩减而直接导致触发本基金合同约定的终止及清算条款，对本基金的继续存续产生较大影响。
5、召开基金份额持有人大会及表决时可能存在的风险
由于单一机构投资者所持有的基金份额占比较高，在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时，单一机构投资者将拥有高的投票权重。

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

《关于准予国投瑞银新能源混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]1154号文）

《关于国投瑞银新能源混合型证券投资基金备案确认的函》（机构部函[2019]2741号）

《国投瑞银新能源混合型证券投资基金基金合同》

《国投瑞银新能源混合型证券投资基金托管协议》

国投瑞银基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批件

其他在中国证监会指定媒介上公开披露的基金份额净值公告、定期报告及临时公告

12.2 存放地点

中国广东省深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

存放网址：http://www.ubssdic.com

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅

咨询电话：国投瑞银基金管理有限公司客户服务热线 400-880-6868、0755-83160000

国投瑞银基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日