

国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)

2023 年第 2 季度报告

2023 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 19 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。

§2 基金产品概况

| | | |
|------------|---|------------|
| 基金简称 | 国投瑞银新兴产业混合（LOF） | |
| 场内简称 | 国投新兴产业 LOF | |
| 基金主代码 | 161219 | |
| 交易代码 | 161219（前端） | 161220（后端） |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2011 年 12 月 13 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 255,348,093.23 份 | |
| 投资目标 | 本基金通过股票与债券等资产的合理配置，精选战略新兴产业及其相关行业中的优质企业进行投资，分享新兴产业发展所带来的投资机会，在有效控制风险的前提下，力争为投资人带来长期的超额收益。 | |
| 投资策略 | 1、 类别资产配置 | |

| | | | |
|------------------|--|------------------|------------------|
| | <p>本基金将采取主动的类别资产配置策略，注重风险与收益的平衡。本基金借鉴瑞银全球资产管理公司投资管理经验，精选战略新兴产业及其相关行业中的优质上市公司股票和较高投资价值的债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。</p> <p>本基金类别资产配置比例遵循以下原则：</p> <p>(1) 股票投资占基金资产的 30-80%；</p> <p>(2) 权证投资占基金资产的比例不高于 3%；</p> <p>(3) 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。</p> <p>2、股票投资管理</p> <p>本基金通过对新兴产业及其相关行业进行辨识、精选，以及对新兴产业及其相关行业的股票进行细致、深入的分析，秉承价值投资的理念，深入挖掘战略新兴产业及其相关行业股票的投资价值，分享战略新兴产业发展所带来的长期投资机会。</p> <p>3、债券投资管理</p> <p>本基金借鉴 UBS Global AM 固定收益组合的管理方法，采取“自上而下”的债券分析方法，确定债券模拟组合，并管理组合风险。</p> | | |
| 业绩比较基准 | 55%×中证新兴产业指数+ 45%×中债总指数 | | |
| 风险收益特征 | 本基金属于中高风险、中高收益的基金品种，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。 | | |
| 基金管理人 | 国投瑞银基金管理有限公司 | | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简 | <table border="1" style="width: 100%;"> <tr> <td style="width: 50%;">国投瑞银新兴产业混合(LOF)A</td> <td style="width: 50%;">国投瑞银新兴产业混合(LOF)C</td> </tr> </table> | 国投瑞银新兴产业混合(LOF)A | 国投瑞银新兴产业混合(LOF)C |
| 国投瑞银新兴产业混合(LOF)A | 国投瑞银新兴产业混合(LOF)C | | |

| | | |
|-----------------|-----------------------|-------------|
| 称 | | |
| 下属分级基金的交易代码 | 161219（前端）、161220（后端） | 018389 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 255,337,249.78 份 | 10,843.45 份 |

§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) | |
|----------------|-------------------------------|------------------|
| | 国投瑞银新兴产业混合(LOF)A | 国投瑞银新兴产业混合(LOF)C |
| 1.本期已实现收益 | -21,025,910.13 | -615.46 |
| 2.本期利润 | -16,958,471.11 | 138.69 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0658 | 0.0434 |
| 4.期末基金资产净值 | 612,900,401.93 | 26,006.49 |
| 5.期末基金份额净值 | 2.400 | 2.398 |

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、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、本基金于2023年4月24日起增加C类基金份额，合同生效当季按实际存续期计算，不按整个自然季度进行折算。

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

1、国投瑞银新兴产业混合(LOF)A:

| 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 | -2.68% | 0.68% | -2.97% | 0.56% | 0.29% | 0.12% |
| 过去六个月 | -0.21% | 0.71% | 0.25% | 0.55% | -0.46% | 0.16% |
| 过去一年 | -3.96% | 0.83% | -8.62% | 0.63% | 4.66% | 0.20% |
| 过去三年 | -3.69% | 1.05% | -0.88% | 0.78% | -2.81% | 0.27% |
| 过去五年 | 96.24% | 1.11% | 16.33% | 0.81% | 79.91% | 0.30% |
| 自基金合同生效起至今 | 435.57% | 1.24% | 57.78% | 0.89% | 377.79% | 0.35% |

2、国投瑞银新兴产业混合(LOF)C:

| 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 |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | -0.21% | 0.69% | -2.14% | 0.57% | 1.93% | 0.12% |

注：1、本基金的业绩比较基准为： $55\% \times \text{中证新兴产业指数} + 45\% \times \text{中债总指数}$ 。

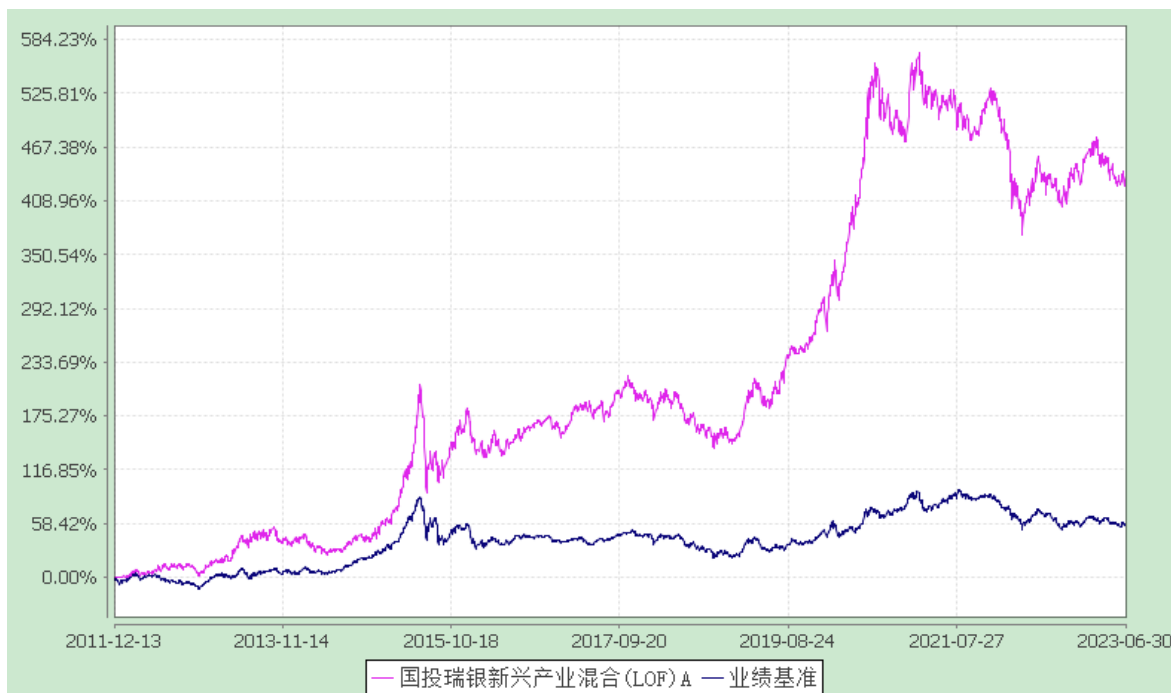
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3、本基金于2023年4月24日起增加C类基金份额，本基金C类基金份额报告期间的起始日为2023年4月24日。

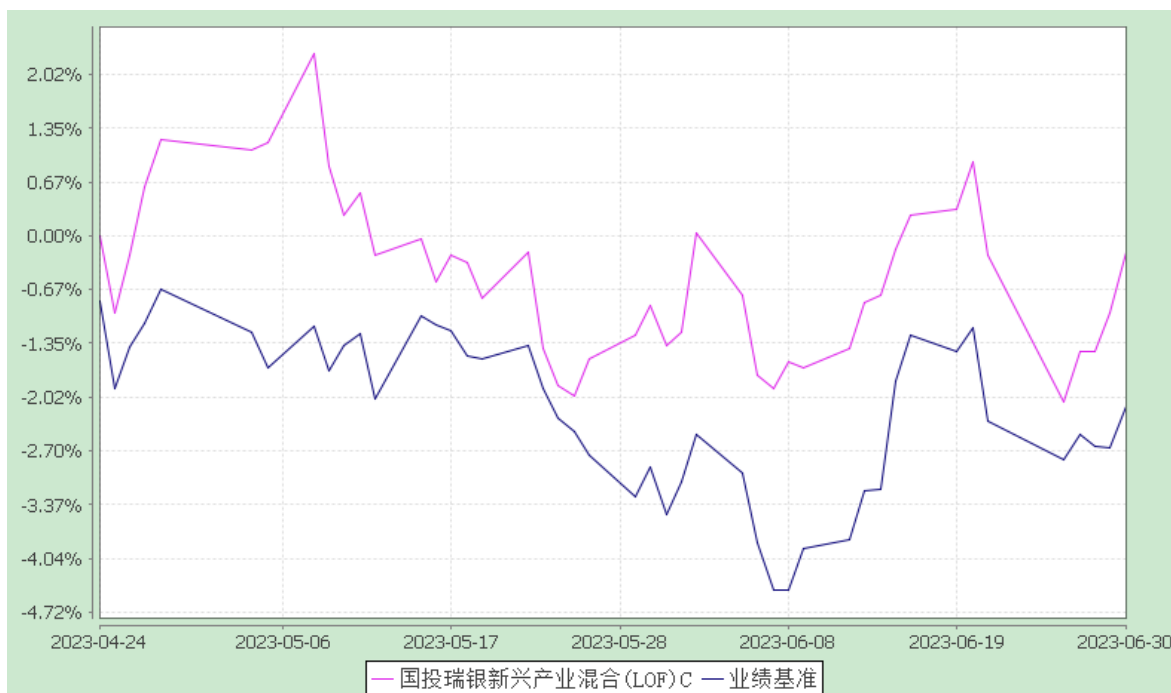
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年12月13日至2023年6月30日)

1. 国投瑞银新兴产业混合(LOF)A:



2. 国投瑞银新兴产业混合(LOF)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。

本基金于2023年4月24日起增加C类基金份额，本基金C类基金份额报告期间的起始日为2023年4月24日。

§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 | | |
| 吴潇 | 本基金基金经理，研究部总监助理 | 2021-12-29 | 2023-06-15 | 9 | 基金经理，研究部总监助理，中国籍，墨尔本大学金融学硕士，9 年证券从业经历。2013 年 10 月加入国投瑞银基金管理有限公司。2014 年 8 月起担任专户投资部投资经理，2016 年 4 月转入研究部，2016 年 4 月 26 日至 2016 年 12 月 28 日期间任国投瑞银新收益混合及国投瑞银新活力混合基金基金经理助理，2016 年 5 月 26 日至 2016 年 12 月 28 日期间任国投瑞银瑞盈混合（LOF）、国投瑞银瑞利混合（LOF）及国投瑞银瑞盛混合（LOF）基金基金经理助理，2016 年 8 月 31 日至 2016 年 12 月 28 日期间任国投瑞银新增长混合基金基金经理助理。2016 年 12 月 29 日起担任国投瑞银瑞盛灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理，2017 年 3 月 1 日起兼任国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金（LOF）及国投瑞银瑞泰多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原国投瑞银瑞泰定增灵活配置混合型证券投资基金）基金经理，2020 年 7 月 10 日起兼任国投瑞银美丽中国灵活配置混合型证券投资基金和国投瑞银优化增强债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 12 月 29 日起兼任国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金 |

| | | | | | |
|----|---------|------------|---|----|---|
| | | | | | <p>(LOF)基金经理。曾于 2017 年 5 月 6 日至 2018 年 12 月 28 日期间担任国投瑞银新活力定期开放混合型证券投资基金基金经理,于 2017 年 5 月 6 日至 2019 年 1 月 4 日期间担任国投瑞银新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理,于 2018 年 1 月 6 日至 2019 年 12 月 27 日期间担任国投瑞银信息消费灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017 年 5 月 6 日至 2021 年 4 月 23 日期间担任国投瑞银岁赢利债券型证券投资基金(原国投瑞银岁赢利一年期定期开放债券型证券投资基金)基金经理,于 2020 年 7 月 10 日至 2021 年 9 月 3 日期间担任国投瑞银锐意改革灵活配置混合型证券投资基金基金经理,于 2021 年 7 月 30 日至 2022 年 8 月 15 日期间担任国投瑞银和旭一年持有期债券型证券投资基金的基金经理。</p> |
| 王鹏 | 本基金基金经理 | 2023-05-30 | - | 15 | <p>基金经理,中国籍,复旦大学经济学博士。15 年证券从业经历。2007 年 7 月至 2008 年 3 月任上海市发改委综合经济研究所助理研究员,2008 年 3 月至 2010 年 11 月任万家基金管理有限公司研究员,2010 年 12 月至 2012 年 4 月任华泰柏瑞基金管理有限公司研究员。2012 年 5 月加入国投瑞银基金管理有限公司研究部。2014 年 12 月 3 日至 2015 年 3 月 9 日期间担任国投瑞银成长优选股票型证券投资基金的基金经理助理。2015 年 4 月 13 日起担任国投瑞银新丝路灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理,2021 年 12 月 21 日起兼任国投瑞银安泽</p> |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>混合型证券投资基金基金经理,2022 年 1 月 25 日起兼任国投瑞银安泰混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 5 月 30 日起兼任国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。曾于 2016 年 1 月 21 日至 2018 年 1 月 15 日期间担任国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金 (原国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金) 基金经理, 于 2016 年 3 月 22 日至 2018 年 3 月 16 日期间担任国投瑞银瑞祥灵活配置混合型证券投资基金 (原国投瑞银瑞祥保本混合型证券投资基金) 基金经理。</p> |
|--|--|--|--|---|

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《证券投资基金经营机构董事、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合规守信情况的说明

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 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了公平交易相关的系列制度，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现，以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，形成了有效的公平交易体系。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。

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% 的情况。

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

格雷厄姆提到：“市场先生情绪波动，还有点精神分裂。有时他兴高采烈，有时又悲观厌世。”5 月市场的恐慌下跌，让人们如此快的遗忘了 1 月份的乐观。我们认为当前市场的下跌，是预期未来可能或已知的灰犀牛和黑天鹅。

我们不否认，世界经济的高光时刻和全球化的蜜月期可能已过。但是我们是乐观主义者，尽管当前荆棘塞道，仍需对未来满怀信心和憧憬。此时此地，我们不应再恐慌和悲观，要相信时间的力量、均值回归的常识。在黎明前的黑暗，让我们细数以下逻辑。其一，A 股大部分宽基指数估值处于历史低位，与美股相比也具吸引力。其二，当前市场的换手率和交易量较低，折射出 A 股情绪的悲观，故投资的安全边际较高。其三，中国通胀压力暂时无忧，货币政策在价格、总量和结构上均有很大的宽松余地。其四，从主要城市地铁客运和拥堵等指标，经济活力已边际趋好。与欧美比较，中国中央政府赤字率低，财政发力空间大，我们认为无需过度担忧地方政府的违约风险。

在后续市场的反弹中，前期表现靓丽的计算机、“中特估”等，可能仍会充当急先锋。与市场认知不同，我们认为计算机和“中特估”，不是资金炒作，而是“低估值+强预期”的逻辑演绎。低估值，是历次板块大行情启动的先决条件，是后续戴维斯上升的前提。强预期，则提供了股价上涨的催化。以计算机为例，自主可控、数字中国、Chatgpt 等，都是基本面预期改善的强逻辑。同时计算机行业要有持续的业绩，必须看 Chatgpt，数字中国等场景落地后的业绩贡献。

医药板块是典型的长坡厚雪的赛道。借鉴老龄化严重的日本，某些细分的医疗器械行业，仍得到较好的发展。我们乐观预计，随着今年高值耗材集采的落地，部分器械细分板块存在重估的可能。疫情结束后，大部分医药公司经营得以恢复，业绩预计会逐季提升。戴维斯双升出现的概率很高。因此，尽管今年以来，医药行业表现平平。从全年维度考虑，我们对某些细分板块保持乐观的观点。

行业配置方面，我们维持适度分散、重点布局的思路。重点布局行业为计算机、

医药等。

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 类份额净值为 2.400 元，C 类份额净值为 2.398 元，本报告期 A 类份额净值增长率为-2.68%，C 类份额净值增长率为-0.21%；A 类同期业绩比较基准收益率为-2.97%，C 类同期业绩比较基准收益率为-2.14%。

4.5 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 | 485,665,954.72 | 79.01 |
| | 其中：股票 | 485,665,954.72 | 79.01 |
| 2 | 固定收益投资 | 57,321,915.10 | 9.33 |
| | 其中：债券 | 57,321,915.10 | 9.33 |
| | 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 | 71,652,681.18 | 11.66 |
| 7 | 其他各项资产 | 64,317.47 | 0.01 |
| 8 | 合计 | 614,704,868.47 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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 | 5,088,576.00 | 0.83 |
| C | 制造业 | 336,373,598.56 | 54.88 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,990,453.47 | 2.28 |
| E | 建筑业 | 10,454.85 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 143,761.67 | 0.02 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 18,217,484.00 | 2.97 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 79,704,271.27 | 13.00 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 15,851,372.15 | 2.59 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 16,239,633.32 | 2.65 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 22,566.57 | 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 | 23,782.86 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 485,665,954.72 | 79.24 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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 | 603658 | 安图生物 | 811,658.00 | 41,987,068.34 | 6.85 |
| 2 | 002831 | 裕同科技 | 1,462,673.00 | 35,674,594.47 | 5.82 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------------|---------------|------|
| 3 | 300253 | 卫宁健康 | 2,570,900.00 | 27,817,138.00 | 4.54 |
| 4 | 600570 | 恒生电子 | 592,400.00 | 26,237,396.00 | 4.28 |
| 5 | 688008 | 澜起科技 | 413,623.00 | 23,750,232.66 | 3.87 |
| 6 | 600887 | 伊利股份 | 831,800.00 | 23,556,576.00 | 3.84 |
| 7 | 600079 | 人福医药 | 797,300.00 | 21,479,262.00 | 3.50 |
| 8 | 601816 | 京沪高铁 | 3,463,400.00 | 18,217,484.00 | 2.97 |
| 9 | 002415 | 海康威视 | 540,900.00 | 17,909,199.00 | 2.92 |
| 10 | 603583 | 捷昌驱动 | 791,332.00 | 17,045,291.28 | 2.78 |

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 | - | - |
| 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） | 57,321,915.10 | 9.35 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 57,321,915.10 | 9.35 |

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 | 110082 | 宏发转债 | 209,800 | 23,812,213.78 | 3.89 |
| 2 | 128134 | 鸿路转债 | 95,102 | 11,829,815.95 | 1.93 |
| 3 | 127076 | 中宠转 2 | 78,532 | 9,702,561.90 | 1.58 |
| 4 | 113584 | 家悦转债 | 83,620 | 8,887,591.79 | 1.45 |
| 5 | 132018 | G 三峡 EB1 | 21,780 | 3,089,731.68 | 0.50 |

**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**

无。

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

无。

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

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 39,433.55 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 24,754.55 |
| 6 | 其他应收款 | 129.37 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |

| | | |
|---|----|-----------|
| 9 | 合计 | 64,317.47 |
|---|----|-----------|

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------------|--------------|
| 1 | 110082 | 宏发转债 | 23,812,213.78 | 3.89 |
| 2 | 128134 | 鸿路转债 | 11,829,815.95 | 1.93 |
| 3 | 127076 | 中宠转 2 | 9,702,561.90 | 1.58 |
| 4 | 113584 | 家悦转债 | 8,887,591.79 | 1.45 |
| 5 | 132018 | G 三峡 EB1 | 3,089,731.68 | 0.50 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 国投瑞银新兴产业混合(LOF)A | 国投瑞银新兴产业混合(LOF)C |
|----------------|------------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 260,293,693.74 | - |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,942,601.86 | 11,586.39 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 6,899,045.82 | 742.94 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 255,337,249.78 | 10,843.45 |

注：本基金基金合同生效日为2011年12月13日，本基金于2023年4月24日起增加C类基金份额。

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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

| 产品特有风险 |
|--|
| <p>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：</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4、基金财产清算（或转型）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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。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导致本基金转换运作方式、与其他基金合并或基金合同终止等情形。</p> <p>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。</p> |

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内管理人发布了关于关于国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)增加 C 类基金份额、投资范围增加存托凭证及增加侧袋机制相关内容并修改法律文件的公告，规定媒介公告时间为 2023 年 04 月 24 日。

2、报告期内管理人发布了关于国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)C 类基金份额开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告，规定媒介公告时间为 2023 年 04 月 24 日。

3、报告期内管理人发布了关于关于国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告，规定媒介公告时间为2023年05月30日。

4、报告期内管理人发布了关于国投瑞银基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告，规定媒介公告时间为2023年05月30日。

5、报告期内管理人发布了关于关于国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告，规定媒介公告时间为2023年06月15日。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

《关于核准国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)募集的批复》(证监许可[2011]1300号文)

《关于国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2011]965号)

《国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)基金合同》

《国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)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

9.2 存放地点

中国广东省深圳市福田区福华一路119号安信金融大厦18楼

存放网址：<http://www.ubssdic.com>

9.3 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

国投瑞银基金管理有限公司

二〇二三年七月二十日