

国投瑞银新增长灵活配置混合型证券投资基金
2024 年第 2 季度报告
2024 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：渤海银行股份有限公司
报告送出日期：二〇二四年七月十八日

§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。

基金托管人渤海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银新增长混合
基金主代码	001499
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 19 日
报告期末基金份额总额	36,402,220.82 份
投资目标	在严格控制风险的基础上，通过对不同资产类别的优化配置及组合精选，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金将采取主动的类别资产配置策略，注重风险与收益平衡。本基金将精选具有较高投资价值的股票和债券，力求实现基金产长期稳定增长。</p> <p>1、类别资产配置</p> <p>本基金根据各类资产的市场趋势和预期收益风险</p>

	<p>比较判别，对股票、债券及货币市场工具等类别资产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。</p> <p>2、股票投资管理</p> <p>本基金管理人在进行行业配置时，将采用自上而下与自下而上相结合的方式确定行业权重。在投资组合管理过程中，基金人也将根据宏观经济形势以及各个行业的基本面特征对配置进行持续动态地调整。</p> <p>本基金根据定量与定性分析确定股票初选库；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。</p> <p>3、债券投资管理</p> <p>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。</p>	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50% + 中债综合指数收益率×50%	
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。	
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司	
基金托管人	渤海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国投瑞银新增长混合 A	国投瑞银新增长混合 C
下属分级基金的交易代码	001499	007326
报告期末下属分级基金的份额总额	20,401,888.62 份	16,000,332.20 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 (2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	国投瑞银新增长混合 A	国投瑞银新增长混合 C
	1.本期已实现收益	586,720.82
2.本期利润	229,746.94	270,308.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0101	0.0258
4.期末基金资产净值	28,680,964.80	22,344,543.96
5.期末基金份额净值	1.4058	1.3965

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。

3.2 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

1、国投瑞银新增长混合 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	0.44%	0.19%	-0.51%	0.37%	0.95%	-0.18%
过去六个月	-0.02%	0.23%	1.78%	0.44%	-1.80%	-0.21%
过去一年	-0.87%	0.18%	-3.31%	0.43%	2.44%	-0.25%
过去三年	4.20%	0.22%	-15.10%	0.52%	19.30%	-0.30%

过去五年	47.50%	0.32%	1.07%	0.57%	46.43%	-0.25%
自基金合同生效起至今	83.08%	0.29%	-6.99%	0.67%	90.07%	-0.38%

2、国投瑞银新增长混合 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
过去三个月	0.42%	0.19%	-0.51%	0.37%	0.93%	-0.18%
过去六个月	-0.07%	0.23%	1.78%	0.44%	-1.85%	-0.21%
过去一年	-0.98%	0.18%	-3.31%	0.43%	2.33%	-0.25%
过去三年	3.88%	0.22%	-15.10%	0.52%	18.98%	-0.30%
过去五年	46.75%	0.32%	1.07%	0.57%	45.68%	-0.25%
自基金合同生效起至今	49.26%	0.32%	2.87%	0.57%	46.39%	-0.25%

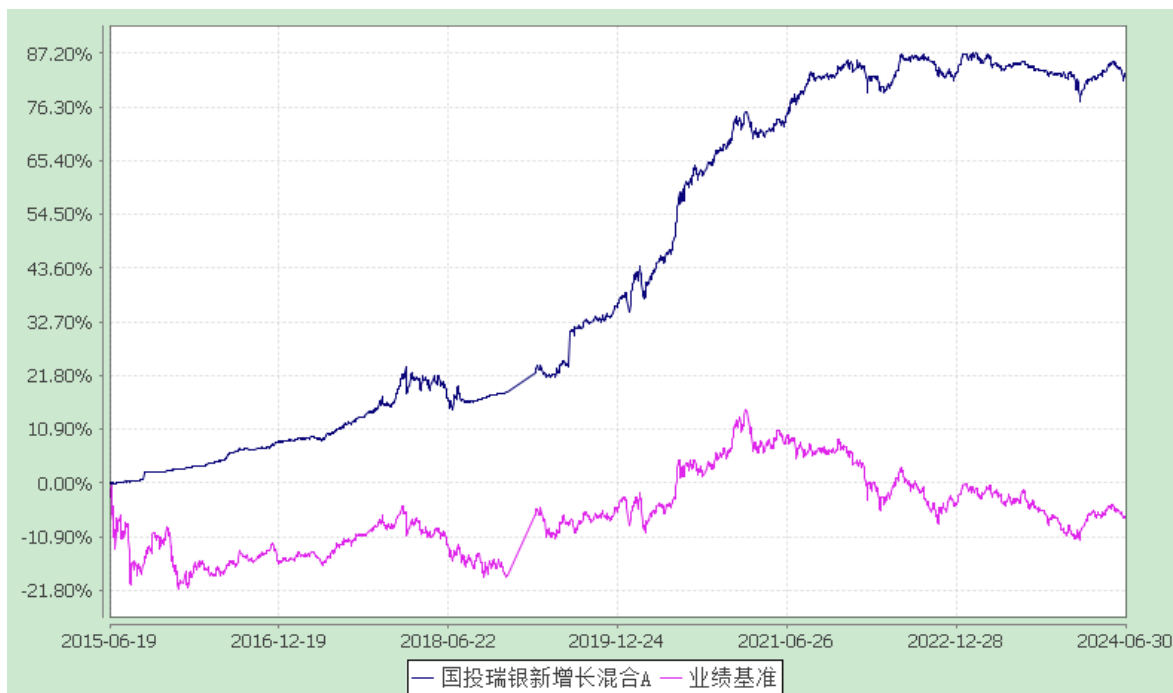
注：1、本基金的业绩比较基准为：沪深300 指数收益率×50% + 中债综合指数收益率×50%。

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

国投瑞银新增长灵活配置混合型证券投资基金
 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
 (2015 年 6 月 19 日至 2024 年 6 月 30 日)

1. 国投瑞银新增长混合 A:



2. 国投瑞银新增长混合 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。

本基金于2019年5月8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2019年5月8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		
桑俊	本基金基金经理，基金投资部部门总经理	2016-06-02	2024-04-26	15	基金经理，基金投资部部门总经理，中国籍，武汉大学经济学博士。15 年证券从业经历。2008 年 9 月至 2012 年 5 月任国海证券研究所分析师。2012 年 5 月加入国投瑞银基金管理有限公司研究部。2013 年 4 月 2 日至 2013 年 8 月 4 日任国投瑞银核心企业股票型证券投资基金基金经理助理，2013 年 8 月 5 日至 2014 年 12 月 3 日任国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金及国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)基金经理助理，2014 年 3 月至 2014 年 12 月 3 日任国投瑞银新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2014 年 7 月 7 日至 2014 年 12 月 3 日任国投瑞银美丽中国灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。2017 年 12 月 1 日起担任国投瑞银研究精选股票型证券投资基金基金经理，2018 年 1 月 6 日起兼任国投瑞银成长优选混合型证券投资基金基金经理，2019 年 4 月 10 日起兼任国投瑞银瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020 年 10 月 27 日起兼任国投瑞银新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月 23 日起兼任国投瑞银价值成长一年持有期混合型证券投资

				<p>基金基金经理，2022 年 1 月 18 日起兼任国投瑞银竞争优势混合型证券投资基金基金经理，2022 年 6 月 29 日起兼任国投瑞银创新动力混合型证券投资基金基金经理。曾于 2015 年 2 月 5 日至 2016 年 12 月 16 日期间担任国投瑞银瑞利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理，于 2014 年 12 月 4 日至 2018 年 2 月 28 日期间担任国投瑞银新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，于 2015 年 3 月 20 日至 2018 年 3 月 23 日期间担任国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，于 2017 年 2 月 8 日至 2018 年 10 月 10 日期间担任国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理，于 2015 年 2 月 4 日至 2018 年 12 月 21 日期间担任国投瑞银新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，于 2016 年 6 月 2 日至 2018 年 12 月 24 日期间担任国投瑞银优选收益混合型证券投资基金基金经理，于 2015 年 5 月 19 日至 2018 年 12 月 28 日期间担任国投瑞银精选收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，于 2016 年 8 月 6 日至 2019 年 5 月 6 日期间担任国投瑞银和盛丰利债券型证券投资基金（原国投瑞银双债丰利两年定期开放债券型证券投资基金）基金经理，于 2021 年 9 月 16 日至 2022 年 9 月 23 日期间担任国投瑞银安睿混合型证券投资基金基金经理，于 2021 年 10 月 25 日至 2024 年 1 月 10 日期间担任国投瑞银安智混合型证券投资基金基</p>
--	--	--	--	--

					金经理，于 2016 年 6 月 2 日至 2024 年 4 月 25 日期间担任国投瑞银新增长灵活配置混合型证券投资基金经理。
敬夏玺	本基金基金经理	2022-04-13	-	14	基金经理，中国籍，中央财经大学金融学硕士。14 年证券从业经历。2010 年 7 月至 2011 年 7 月期间任工银瑞信基金管理有限公司交易员，2011 年 7 月至 2016 年 5 月任融通基金管理有限公司投资经理，2016 年 5 月至 2021 年 9 月任新疆前海联合基金管理有限公司固收基金经理，2021 年 9 月加入国投瑞银基金管理有限公司固定收益部。2022 年 4 月 13 日起担任国投瑞银新增长灵活配置混合型证券投资基金及国投瑞银新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022 年 6 月 14 日起兼任国投瑞银顺和一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 7 月 12 日起兼任国投瑞银顺熙一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 8 月 16 日起兼任国投瑞银顺达纯债债券型证券投资基金基金经理，2023 年 3 月 7 日起兼任国投瑞银顺立纯债债券型证券投资基金基金经理，2023 年 3 月 15 日起兼任国投瑞银顺意一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2024 年 3 月 13 日起兼任国投瑞银启源利率债债券型证券投资基金基金经理，2024 年 5 月 17 日起兼任国投瑞银顺成 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。曾于 2021 年 12 月 31 日至 2023 年 7 月 26 日期间担任国投瑞银顺银 6 个月定期开放债券型发起式

					证券投资基金基金经理，于 2022 年 7 月 20 日至 2024 年 1 月 10 日期间担任国投瑞银安智混合型证券投资基金基金经理。
殷瑞飞	本基金基金经理，量化投资部部门副总经理	2023-10-26	-	16	基金经理，量化投资部部门副总经理，中国籍，厦门大学统计学博士。16 年证券从业经历。2008 年 3 月至 2011 年 6 月任汇添富基金管理公司风险管理分析师。2011 年 6 月加入国投瑞银基金管理有限公司。2013 年 4 月 2 日至 2013 年 9 月 25 日担任国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金的基金经理助理，2013 年 5 月 17 日至 2013 年 9 月 25 日担任国投瑞银沪深 300 金融地产指数证券投资基金(LOF)的基金经理助理。2014 年 7 月 24 日起担任国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)基金经理，2018 年 8 月 1 日起兼任国投瑞银中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金经理，2019 年 6 月 11 日起兼任国投瑞银沪深 300 指数量化增强型证券投资基金基金经理，2023 年 10 月 26 日起兼任国投瑞银新增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。曾于 2016 年 4 月 26 日至 2018 年 6 月 11 日期间担任国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，于 2015 年 11 月 17 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 2013 年 9 月 26 日至 2020 年 9 月 18 日期间担任国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理，于 2013 年 10 月 26 日至 2023 年

				7 月 14 日期间担任国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金（LOF）基金经理，于 2021 年 10 月 15 日至 2024 年 1 月 10 日期间兼任国投瑞银安睿混合型证券投资基金基金经理，于 2022 年 12 月 5 日至 2024 年 6 月 3 日期间兼任国投瑞银专精特新量化选股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》中关于证券投资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% 的交易情况。

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

2024 年二季度，A 股市场整体保持震荡，更多以结构性行情为主。从风格来看，红利和大盘风格依旧延续强势表现，上证指数下跌 2.42%，沪深 300 指数下跌 2.14%，中证红利指数下跌 0.48%，中证 1000 指数下跌 10.02%。不同行业赛道分化也较为明显，银行、煤炭代表的股息率较高的行业领涨，电子行业受人工智能概念的影响，也凸现出不错的收益。

当前我国经济已由高速增长阶段转向高质量发展阶段，正处在转变发展方式、优化经济结构、转换增长动力的攻关期，虽然面临多重挑战，但复苏的大趋势不变。新“国九条”是中国资本市场发展的一系列政策措施，强调以人民为中心的价值取向，充分体现强监管、防风险、促高质量发展的主线，未来的市场投资或提升对公司基本面信息的聚焦和关注。货币政策适度宽松、财政政策适度积极的政策框架在未来大概率会继续保持。当前主要指数估值水平仍处于历史均值水位以下，具备中长期配置的吸引力，我们认为，A 股市场整体机会仍大于风险。

债券方面，进入二季度末，债券市场维持强势，长端利率再度创下新低。随着淡季到来，经济数据出现了边际走弱的迹象，前期地产政策放松对地产高频数据也并未带来显著的影响，5 月新增信贷与 M2 增速继续回落。尽管央行再度提示非银主体大量持有中长期债券的期限错配和利率风险，跨季资金面略有收紧但也并未出现大幅波动，市场对于央行的口头干预逐步脱敏。在这样的背景下，资产荒的格局并未缓解，中短端利率仍在持续下行，信用利差持续压缩。

基金投资操作上，我们将继续使用科学、系统的方法，挑选具有长期优势的投资标的构造组合，同时基于系统化、纪律化的风险管理体系控制组合波动，努力降低组合回撤，力争为投资者获得良好的投资收益。

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 1.4058 元，C 类份额净值为 1.3965 元。本报告期 A 类份额净值增长率为 0.44%，C 类份额净值增长率为 0.42%；本报告期同期业绩比较基准收益率为-0.51%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内本基金在 20240412 至 20240625 出现连续 49 个工作日基金资产净值数

低于 5000 万的情形，至本报告期末已高于 5000 万元，基金管理人依据相关规定在本报告中披露，提醒基金份额持有人关注。

§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	8,103,239.53	15.70
	其中：股票	8,103,239.53	15.70
2	固定收益投资	40,443,616.39	78.38
	其中：债券	40,443,616.39	78.38
	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	2,959,761.55	5.74
7	其他各项资产	93,002.72	0.18
8	合计	51,599,620.19	100.00

注：1、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。

2、本基金不参与转融通证券出借业务。

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	277,406.00	0.54
B	采矿业	256,819.00	0.50

C	制造业	3,476,481.32	6.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	902,531.46	1.77
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	135,068.00	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	394,325.00	0.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	756,994.75	1.48
J	金融业	1,871,998.00	3.67
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	31,616.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,103,239.53	15.88

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	600050	中国联通	48,800.00	229,360.00	0.45
2	601728	中国电信	37,200.00	228,780.00	0.45
3	600000	浦发银行	26,600.00	218,918.00	0.43
4	600016	民生银行	57,600.00	218,304.00	0.43
5	600015	华夏银行	32,800.00	209,920.00	0.41
6	601166	兴业银行	11,800.00	207,916.00	0.41
7	601939	建设银行	27,700.00	204,980.00	0.40
8	600598	北大荒	16,400.00	204,836.00	0.40
9	600941	中国移动	1,900.00	204,250.00	0.40
10	300760	迈瑞医疗	700.00	203,637.00	0.40

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	24,633,526.57	48.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,242,715.85	20.07
	其中：政策性金融债	10,242,715.85	20.07
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）	5,567,373.97	10.91
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,443,616.39	79.26

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	230202	23 国开 02	100,000	10,242,715.85	20.07
2	019729	23 国债 26	70,000	7,272,346.03	14.25
3	019733	24 国债 02	70,000	7,075,114.79	13.87
4	019725	23 国债 22	60,000	6,253,167.12	12.25
5	019739	24 国债 08	40,000	4,032,898.63	7.90

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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中，中国民生银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。基金管理人认为，上述事件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。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体存在本期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、处罚的情形。

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	72,208.19

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,527.05
6	其他应收款	19,267.48
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	93,002.72

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	128066	亚泰转债	136,766.44	0.27
2	123100	朗科转债	136,608.56	0.27
3	127055	精装转债	134,990.92	0.26
4	127084	柳工转 2	134,553.75	0.26
5	127049	希望转 2	133,207.81	0.26
6	128130	景兴转债	132,642.53	0.26
7	113058	友发转债	132,016.60	0.26
8	128081	海亮转债	130,207.00	0.26
9	127015	希望转债	129,512.43	0.25
10	123190	道氏转 02	129,224.41	0.25
11	123193	海能转债	126,559.89	0.25
12	111015	东亚转债	126,228.70	0.25
13	113021	中信转债	125,242.48	0.25
14	128108	蓝帆转债	123,888.03	0.24
15	113665	汇通转债	121,618.06	0.24
16	123147	中辰转债	121,174.57	0.24
17	123225	翔丰转债	120,648.77	0.24
18	123063	大禹转债	117,729.65	0.23
19	123087	明电转债	117,171.86	0.23
20	123203	明电转 02	117,088.82	0.23
21	128049	华源转债	117,043.79	0.23
22	128083	新北转债	115,764.78	0.23
23	113516	苏农转债	115,478.71	0.23
24	123107	温氏转债	114,841.13	0.23
25	123204	金丹转债	113,009.60	0.22

26	128087	孚日转债	110,621.10	0.22
27	113532	海环转债	110,270.68	0.22
28	113524	奇精转债	110,184.56	0.22
29	113044	大秦转债	109,441.24	0.21
30	123191	智尚转债	109,252.70	0.21
31	128048	张行转债	108,417.48	0.21
32	113609	永安转债	106,151.00	0.21
33	118008	海优转债	106,098.24	0.21
34	110063	鹰 19 转债	105,464.73	0.21
35	110095	双良转债	104,732.35	0.21
36	127052	西子转债	101,712.82	0.20
37	123149	通裕转债	100,984.11	0.20
38	123213	天源转债	99,761.80	0.20
39	113530	大丰转债	99,334.11	0.19
40	123128	首华转债	99,064.58	0.19
41	123184	天阳转债	98,432.16	0.19
42	128144	利民转债	98,357.40	0.19
43	113052	兴业转债	97,395.90	0.19
44	123085	万顺转 2	97,204.11	0.19
45	127061	美锦转债	96,796.25	0.19
46	123146	中环转 2	93,442.74	0.18
47	113033	利群转债	85,393.57	0.17
48	110047	山鹰转债	81,510.56	0.16
49	127022	恒逸转债	613.25	0.00

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	国投瑞银新增长混 合A	国投瑞银新增长混 合C
本报告期期初基金份额总额	40,431,472.16	32,397,962.90
报告期期间基金总申购份额	719,989.47	10,192,835.34

减：报告期期间基金总赎回份额	20,749,573.01	26,590,466.04
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	20,401,888.62	16,000,332.20

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240401-20240408	22,814,822.80	0.00	22,814,822.80	0.00	0.00%
	2	20240626-20240630	0.00	10,084,275.73	0.00	10,084,275.73	27.70%
	3	20240401-20240411	18,844,331.55	0.00	18,844,331.55	0.00	0.00%

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（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。

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国投瑞银新增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告，规定媒介公告时间为 2024 年 04 月 26 日。

2、报告期内管理人发布了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及投资者适当性信息的公告，规定媒介公告时间为 2024 年 05 月 24 日。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

《关于准予国投瑞银新增长灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]1117 号）

《关于国投瑞银新增长灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》（机构部函[2015]1890 号）

《国投瑞银新增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

《国投瑞银新增长灵活配置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

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

二〇二四年七月十八日