

国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

2021年第2季度报告

2021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：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年七月二十一日

§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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2021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2021年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 国泰民益灵活配置混合(LOF) |
| 场内简称 | 国泰民益 |
| 基金主代码 | 160220 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年12月30日 |
| 报告期末基金份额总额 | 545,902,790.41份 |
| 投资目标 | 前瞻性把握不同时期股票市场、债券市场、银行间市场的收益率，在控制下行风险的前提下为投资人获取稳健回报。 |
| 投资策略 | 1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、权证投资策略。 |
| 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、预期收益高于货币市 |

| | | |
|-----------------|--------------------|------------------|
| | 场基金和债券型基金，低于股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 国泰基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 宁波银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 国泰民益灵活配置混合(LOF)A | 国泰民益灵活配置混合(LOF)C |
| 下属分级基金的交易代码 | 160220 | 160226 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 257,050,030.32 份 | 288,852,760.09 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 (2021年4月1日-2021年6月30日) | |
|----------------|-------------------------------|------------------|
| | 国泰民益灵活配置混合(LOF)A | 国泰民益灵活配置混合(LOF)C |
| 1.本期已实现收益 | 7,859,542.33 | 8,205,717.48 |
| 2.本期利润 | 13,630,899.06 | 13,428,550.80 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0542 | 0.0542 |
| 4.期末基金资产净值 | 442,819,185.75 | 504,259,763.54 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.7227 | 1.7457 |

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

1、国泰民益灵活配置混合(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 | 3.14% | 0.20% | 2.03% | 0.49% | 1.11% | -0.29% |
| 过去六个月 | 4.63% | 0.28% | 0.70% | 0.66% | 3.93% | -0.38% |
| 过去一年 | 15.18% | 0.32% | 12.51% | 0.66% | 2.67% | -0.34% |
| 过去三年 | 39.01% | 0.65% | 26.94% | 0.67% | 12.07% | -0.02% |
| 过去五年 | 33.03% | 0.54% | 28.09% | 0.55% | 4.94% | -0.01% |
| 自基金合同 生效起至今 | 72.27% | 0.45% | 44.21% | 0.45% | 28.06% | 0.00% |

2、国泰民益灵活配置混合(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 |
|---------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 3.11% | 0.20% | 2.03% | 0.49% | 1.08% | -0.29% |
| 过去六个月 | 4.58% | 0.28% | 0.70% | 0.66% | 3.88% | -0.38% |
| 过去一年 | 15.07% | 0.32% | 12.51% | 0.66% | 2.56% | -0.34% |
| 过去三年 | 38.55% | 0.65% | 26.94% | 0.67% | 11.61% | -0.02% |
| 过去五年 | 35.12% | 0.55% | 28.09% | 0.55% | 7.03% | 0.00% |
| 自新增C类 份额至今 | 36.49% | 0.52% | 31.62% | 0.52% | 4.87% | 0.00% |

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

国泰民益灵活配置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
(2013年12月30日至2021年6月30日)

1. 国泰民益灵活配置混合(LOF)A:



注：1、本基金合同生效日为 2013 年 12 月 30 日，本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

2、自 2017 年 12 月 25 日起本基金业绩比较基准由原“三年期银行定期存款利率(税后)+2%”，变更为“沪深 300 指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%”。

2. 国泰民益灵活配置混合(LOF)C:



注：1、本基金合同生效日为 2013 年 12 月 30 日，本基金在六个月建仓期结束时，各项资产

配置比例符合合同约定。自 2015 年 11 月 17 日起，本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码。

2、自 2017 年 12 月 25 日起本基金业绩比较基准由原“三年期银行定期存款利率(税后)+2%”，变更为“沪深 300 指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%”。

§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 | | |
| 樊利安 | 国泰浓益灵活配置混合、国泰民益灵活配置混合(LOF)、国泰融丰外延增长灵活配置混合(LOF)、国泰宏益一年持有期混合、国泰浩益18个月封闭运作混合、国泰同益18个月持有期混合的 | 2014-10-21 | - | 15年 | 硕士。曾任职上海鑫地投资管理有限公司、天治基金管理有限公司等。2010年7月加入国泰基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2014年10月起任国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(原国泰淘新灵活配置混合型证券投资基金)和国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年1月至2018年8月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年3月至2019年1月任国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年5月至2020年5月任国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年6月至2019年12月任国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年6月至2018年2月任国泰生益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年6月至2017年1月任国泰金泰平衡混合型证券投资基金(由金泰证券投资基金转型而来)的基金经理，2016年5月至2017年11月任国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 |

| | | | | |
|--|------------------|--|--|---|
| | <p>基金经 理</p> | | | <p>年 8 月至 2018 年 8 月任国泰添益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 4 月任国泰福益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 11 月至 2018 年 12 月任国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2019 年 12 月任国泰普益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2020 年 5 月任国泰安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 3 月任国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 5 月任国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 6 月任国泰景益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 8 月任国泰信益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 9 月任国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 5 月任国泰嘉益灵活配置混合型证券投资基金、国泰众益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 9 月任国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月至 2018 年 11 月任国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月至 2018 年 9 月任国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月至 2018 年 9 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 11 月起兼任国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）的基金经理，</p> |
|--|------------------|--|--|---|

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>2018年1月至2018年5月任国泰瑞益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2018年1月至2018年8月任国泰恒益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2018年9月至2020年8月任国泰融信灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来)的基金经理,2019年5月至2020年6月任国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金和国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2019年8月至2020年10月任国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2020年6月起兼任国泰宏益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理,2020年8月起兼任国泰浩益18个月封闭运作混合型证券投资基金的基金经理,2021年4月起兼任国泰同益18个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月至2016年1月任研究部副总监,2016年1月至2018年7月任研究部副总监(主持工作),2018年7月至2019年7月任研究部总监。</p> |
|--|--|--|--|--|

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所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

经历一季度的调整后，二季度市场稳步反弹，继续保持了明显的结构性差异。最终上证指数上涨 4.34%，深证成指上涨 10.04%，创业板指上涨 26.05%。从申万一级行业来看，电气设备、电子、汽车行业涨幅较大，家电、农林牧渔、房地产等行业小幅下跌。

二季度经济延续了“稳货币、紧信用”的政策，市场保持了较好的流动性，银行间 DR007 保持在 2.1-2.2% 之间，这是支持市场走强的一个基本要素。我们认为，由于全球范围内疫情的反复，各国短期内难以收缩流动性，同时全球通胀的上行，部分源于疫情造成的供给收缩，也不支持欧美的政策转向。二季度 10 年美债收益率从 1.74% 回调到 1.47%，也反映了短期市场流动性难以收缩的预期。支持市场走强的另一个因素，我们认为还是中国的比较优势。在疫情的影响下，中国的新能源车、光伏、半导体等行业得到了更快的发展；同时，疫情影响了化工、有色等周期行业的供给，叠加行业自身周期，使产品价格快速上涨，企业利润大幅增长。

本基金以绝对收益策略为主，二季度对持仓结构持续进行调整，主要增持了光伏、锂电池、疫苗、半导体等行业个股，同时阶段性的配置了煤炭、化工等价格驱动型股票。本基金还积极地参与科创板、创业板、主板的新股配售，债券方面主要以高等级信用债票息策略为主，取得了较好收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰民益灵活配置混合 A 在 2021 年第二季度的净值增长率为 3.14%，同期业绩比较基准收益率为 2.03%。

国泰民益灵活配置混合 C 在 2021 年第二季度的净值增长率为 3.11%，同期业绩比较基准收益率为 2.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度到年底，一个确定性的事情是中国和欧美主要国家的新冠疫苗接种将达到较高的比例，那么其经济增长也会进一步恢复，流动性收紧的预期又会加强，美联储 Taper 和加息预期可能又会起来，10 年美债收益率可能再次回升。但我们判断，经济修复是一个缓慢的过程，政策收缩的节奏也是一个渐进的过程，对市场的冲击应该也是阶段性的。从 A 股市场来看，虽然经过上半年的估值修复，行业之间的差距仍然巨大，我们判断后续仍然会呈现结构性的行情。

基于以上判断，我们三季度权益仓位继续保持稳定，继续自下而上寻找景气行业和个股机会，规避估值脱离基本面的品种。在新能源车、光伏、半导体等行业，行业整体景气度较高，但部分公司股价已经反映了其基本面变化，需要寻找预期差较大品种以及紧密跟踪其变化；在风格上，我们判断中证 500 仍然会强于沪深 300。债券方面，我们维持配置短久期高评级信用债，采用持有到期的票息策略。

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 | 179,585,515.15 | 18.94 |
| | 其中：股票 | 179,585,515.15 | 18.94 |
| 2 | 固定收益投资 | 648,104,040.84 | 68.34 |
| | 其中：债券 | 648,104,040.84 | 68.34 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 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 | 103,800,000.00 | 10.94 |
| | 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 | 4,764,974.82 | 0.50 |
| 7 | 其他各项资产 | 12,142,164.98 | 1.28 |
| 8 | 合计 | 948,396,695.79 | 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 | 11,290.28 | 0.00 |
| B | 采矿业 | 6,248,123.22 | 0.66 |
| C | 制造业 | 124,800,183.07 | 13.18 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,020.39 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 25,371.37 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 3,459,273.58 | 0.37 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,267,381.00 | 0.66 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 15,875,265.46 | 1.68 |
| J | 金融业 | 14,250,453.10 | 1.50 |
| 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 | 1,546,059.15 | 0.16 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 7,089,094.53 | 0.75 |
| 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 | 179,585,515.15 | 18.96 |

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 | 300776 | 帝尔激光 | 126,240 | 18,855,206.40 | 1.99 |
| 2 | 300460 | 惠伦晶体 | 298,093 | 7,049,899.45 | 0.74 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 12,200 | 6,524,560.00 | 0.69 |
| 4 | 688188 | 柏楚电子 | 13,748 | 5,994,128.00 | 0.63 |
| 5 | 600887 | 伊利股份 | 160,000 | 5,892,800.00 | 0.62 |
| 6 | 600690 | 海尔智家 | 220,300 | 5,707,973.00 | 0.60 |
| 7 | 002643 | 万润股份 | 295,600 | 5,255,768.00 | 0.55 |
| 8 | 603799 | 华友钴业 | 47,619 | 5,168,566.26 | 0.55 |
| 9 | 601166 | 兴业银行 | 234,600 | 4,821,030.00 | 0.51 |
| 10 | 603588 | 高能环境 | 307,840 | 4,457,523.20 | 0.47 |

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 | 47,315,134.00 | 5.00 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 130,328,000.00 | 13.76 |
| 5 | 企业短期融资券 | 150,056,000.00 | 15.84 |
| 6 | 中期票据 | 310,870,000.00 | 32.82 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 9,534,906.84 | 1.01 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 648,104,040.84 | 68.43 |

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 | 019640 | 20 国债 10 | 435,340 | 43,534,000.00 | 4.60 |
| 2 | 072100103 | 21 银河证券 CP005 | 400,000 | 39,988,000.00 | 4.22 |
| 3 | 012101553 | 21 电网 SCP015 | 300,000 | 30,030,000.00 | 3.17 |
| 4 | 012101876 | 21 北控集 SCP001 | 300,000 | 30,000,000.00 | 3.17 |
| 5 | 102000314 | 20 广晟 MTN002 | 300,000 | 30,000,000.00 | 3.17 |

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

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（除“银河证券”、“招商证券”违规外）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。

银河证券重庆万象河营业部因未采取有效措施规范员工的执业行为、未有效监督管理营业部办公场所电子设备的规范使用等原因，受到地方证监局警示处分。

招商证券因违反反洗钱法、未依法履行职责等原因，受到央行派出机构、上交所的罚款、警示等公开处罚。

本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

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 | 152,597.94 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,373,262.04 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 8,461,214.13 |
| 5 | 应收申购款 | 155,090.87 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 12,142,164.98 |

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 | 128141 | 旺能转债 | 5,076,255.24 | 0.54 |
| 2 | 113011 | 光大转债 | 4,394,351.60 | 0.46 |

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 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 603799 | 华友钴业 | 5,168,566.26 | 0.55 | 增发中签 |

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 国泰民益灵活配置混合 | 国泰民益灵活配置混合 |
|----|------------|------------|
|----|------------|------------|

| | (LOF)A | (LOF)C |
|----------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 263,067,474.97 | 251,318,107.01 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 77,720,914.21 | 59,813,964.94 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 83,738,358.86 | 22,279,311.86 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 257,050,030.32 | 288,852,760.09 |

§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，本基金的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、关于核准国泰淘新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）募集的批复（已更名为国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF））
- 2、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同
- 3、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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。

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

二〇二一年七月二十一日