

**国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金（LOF）**

**2021 年中期报告**

**2021 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：二〇二一年八月三十日

## 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 2021 年 8 月 27 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>2 基金简介</b> .....	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.....	7
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
<b>4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>7 投资组合报告</b> .....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42

7.12 投资组合报告附注.....	42
<b>8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.4 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.....	44
<b>9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>10 重大事件揭示.....</b>	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	46
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>47</b>
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.....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
<b>12 备查文件目录.....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
基金简称	国投瑞银瑞盈混合 (LOF)
场内简称	国投瑞盈 LOF
基金主代码	161225
交易代码	161225
基金运作方式	契约型基金。本基金合同生效后，在封闭期内不开放申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金 (LOF)。本基金基金合同生效后，封闭期为 18 个月 (含 18 个月)，本基金封闭期自基金合同生效之日起至 18 个月后对应日前一个工作日止。
基金合同生效日	2015 年 5 月 19 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	54,856,595.26 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 8 月 14 日

注：本基金原场内简称为：国投瑞盈

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，通过股票与债券等资产的合理配置，力争基金资产的持续稳健增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略包括类别资产配置策略、股票精选策略、折价与套利策略、债券投资策略等。</p> <p>(一) 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、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>(二) 股票投资管理</p> <p>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，基金管理人也将根据宏观经济形势以及各个行业的基本面特征对行业配置进行持续动态地调整。个股基本面分析的主要内容包括价值评估、成长性评估、现金流预测和行业环境评估等。</p>

	<p>（三）折价与套利策略 折价与套利策略主要包括可转债投资策略、定向增发策略、大宗交易策略。</p> <p>（四）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。</p> <p>（五）衍生品投资策略 1、股指期货投资策略 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。</p> <p>2、国债期货投资策略 为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。</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，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。

## 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	010-66594319
	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		叶柏寿	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸	《证券时报》
--------------	--------

名称	
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	深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任 公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## 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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	11,257,275.73
本期利润	14,694,854.36
加权平均基金份额本期利润	0.2858
本期加权平均净值利润率	11.63%
本期基金份额净值增长率	12.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	65,107,186.30
期末可供分配基金份额利润	1.1869
期末基金资产净值	141,364,871.85
期末基金份额净值	2.577
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	162.92%

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

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	0.90%	0.75%	-1.02%	0.40%	1.92%	0.35%
过去三个月	7.02%	0.88%	2.03%	0.49%	4.99%	0.39%
过去六个月	12.53%	1.12%	0.70%	0.66%	11.83%	0.46%
过去一年	44.61%	1.32%	12.51%	0.66%	32.10%	0.66%
过去三年	131.74%	1.48%	26.94%	0.67%	104.80%	0.81%
自基金合同生效起至今	162.92%	1.28%	13.72%	0.74%	149.20%	0.54%

注：1、本基金的业绩比较基准中，沪深 300 指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数，该指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，抗操纵性强，并且有较高的知名度和市场影响力。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，本基金选用沪深 300 指数收益率和中债综合指数收益率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

国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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

（2015 年 5 月 19 日至 2021 年 6 月 30 日）



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 2021 年 6 月底，在公募基金方面，公司共管理 70 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		
吴潇	本基金基金经理、研究部总监助理	2017-03-01	-	7	中国籍，硕士，具有基金从业资格。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。曾任国投瑞银新活力定期开放混合型证券投资基金、国投瑞银新收益灵活配置混合型证券投资基金及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。现任国投瑞银瑞盛灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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）、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）、国投瑞银美丽中国灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银锐意改革灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银优化增强债券型证券投资基金及国投瑞银和旭一年持有期债券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

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，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 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

今年上半年，随着疫苗的产能不断释放，各国加速了疫苗的接种，发达国家致力于在夏天通过高接种率完成群体免疫，但是变种病毒传染性的增强，短时间新冠病毒难以彻底根除，导致社会生活方式发生根本变化，各类物资的供给随时会受到冲击性影响，生产要素不可逆的降低，人类社会尝试寻找控制病毒传播和全面复工复产中的平衡。

从经济数据上来看，去年基数较低，全面复苏是主题，供需失衡造成大宗商品、海运等价格的飞速上涨。欧美发达国家 PPI, CPI 的压力逐步开始显现。国内的经济保持了良好的韧性，进出口, PMI 以及社融等经济数据依然保持高位，预计经济未来缓慢下行，将逐步恢复到潜在增长水平。

权益市场分化较为严重，新兴产业由于业绩不断的超出市场的预期而获得了很好的表现，半导体、新能源、生物医药等涨幅领先，而消费、金融地产等传统经济周期相关

行业表现较为落后。

本报告期内，我们继续减持了对电子的配置，增加了对计算机、消费的配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额净值为 2.577 元，本报告期份额净值增长率为 12.53%，同期业绩比较基准收益率为 0.70%

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内的宏观相对平稳，海外宏观波动加大，随着美国强劲的复苏预期以及美联储对远期通胀的上调，提前缩减购债和加息成为市场最大的潜在灰犀牛。另一方面，市场依旧担心疫情造成的 K 型复苏导致后期经济的增长动能乏力，从国内的消费数据也可以看出，消费的动能并不明显。未来有可能出现在脉冲式的复工复产周期过后，经济增长持续性堪忧，这将延续各国的货币政策的宽松的窗口。目前市场整体资金量充沛，总是在寻找新的方向，依然会有结构性的行情，但波动性加大，风险也在积聚。不少成长周期股在周期顶点给了长期的成长估值，但是市场就像一个钟摆，永远是从一头到另一头，未来潮水褪去时，价值也会回归。我们会继续从长期思维出发，为投资人精选优质公司，争取继续获得一个合理的回报。

#### 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

本基金本期已实现收益为 11,257,275.73 元，期末可供分配利润为 65,107,186.30 元。  
本基金本报告期末未进行收益分配。

#### 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”）在国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（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：国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	13,240,488.05	6,819,365.41
结算备付金		80,373.06	106,035.26
存出保证金		16,559.16	20,514.92
交易性金融资产	6.4.7.2	128,305,948.43	117,708,672.40
其中：股票投资		128,249,622.73	117,708,672.40
基金投资		-	-
债券投资		56,325.70	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	379,045.94
应收利息	6.4.7.5	1,412.68	1,110.24
应收股利		-	-
应收申购款		105,209.47	7,763.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		141,749,990.85	125,042,507.58
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		20,023.66	183,616.86
应付管理人报酬		167,833.44	156,600.30
应付托管费		27,972.22	26,100.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	55,194.40	44,937.94

应交税费		0.33	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	114,094.95	170,374.99
负债合计		385,119.00	581,630.11
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	54,856,595.26	54,355,697.36
未分配利润	6.4.7.10	86,508,276.59	70,105,180.11
所有者权益合计		141,364,871.85	124,460,877.47
负债和所有者权益总计		141,749,990.85	125,042,507.58

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 2.577 元，基金份额总额 54,856,595.26 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>16,115,794.62</b>	<b>16,684,394.18</b>
1.利息收入		16,967.79	23,160.46
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,780.22	19,643.19
债券利息收入		2,187.57	3,517.27
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）		12,619,584.75	21,608,185.14
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,493,346.15	20,399,210.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-975.00	145,512.50
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,127,213.60	1,063,462.48
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,437,578.63	-5,010,401.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	41,663.45	63,449.98
<b>减：二、费用</b>		<b>1,420,940.26</b>	<b>1,252,646.98</b>
1. 管理人报酬		939,435.48	770,503.38
2. 托管费		156,572.65	128,417.23
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	190,231.14	227,100.46
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.04	0.47
7. 其他费用	6.4.7.19	134,700.95	126,625.44
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>14,694,854.36</b>	<b>15,431,747.20</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>14,694,854.36</b>	<b>15,431,747.20</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	54,355,697.36	70,105,180.11	124,460,877.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,694,854.36	14,694,854.36
三、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）	500,897.90	1,708,242.12	2,209,140.02
其中：1.基金申购款	12,288,133.23	18,780,965.09	31,069,098.32
2.基金赎回款	-11,787,235.33	-17,072,722.97	-28,859,958.30
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	54,856,595.26	86,508,276.59	141,364,871.85
项目	上年度可比期间		

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	80,868,125.92	42,380,125.41	123,248,251.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,431,747.20	15,431,747.20
三、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）	-26,128,421.61	-14,983,637.78	-41,112,059.39
其中：1.基金申购款	6,911,357.70	4,159,463.90	11,070,821.60
2.基金赎回款	-33,039,779.31	-19,143,101.68	-52,182,880.99
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	54,739,704.31	42,828,234.83	97,567,939.14

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

国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）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[2015]478号《关于准予国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由国投瑞银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期间不定，首次募集期间为 2015 年 4 月 22 日至 2015 年 5 月 13 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,377,252,263.03 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 526 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,377,739,275.28 份基金份额，其中认购资金利息折合 487,012.25 份基金份额。

本基金的基金管理人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。

根据《国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金基金合同生效后，封闭期为 18 个月(含 18 个月)，在封闭期内不开放申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金(LOF)。

经深圳交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]389 号文审核同意，本基金 216,230,892.00 份基金份额于 2015 年 8 月 14 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据本基金的基金管理人于 2016 年 11 月 17 日发布的《关于国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金转为上市开放式基金(LOF)的公告》，本基金的封闭期自 2015 年 5 月 19 日起至 2016 年 11 月 18 日止，自 2016 年 11 月 19 日起本基金转换为上市开放式基金(LOF)。基金名称变更为“国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”。本基金转换为上市开放式基金(LOF)后的基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制等条款，适用《国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》中转换为上市开放式基金(LOF)后的有关约定。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、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)、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证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)。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。本基金的投资组合比例为：封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%；转换为上市开放式基金(LOF)后股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产的 3%。在封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金(LOF)后，每个交易日日终在扣除国债期货和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投资比例合计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。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%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 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

本基金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一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期无须说明的会计差错和更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来

等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	13,240,488.05
定期存款	-
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	-
合计	13,240,488.05

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	103,458,889.67	128,249,622.73	24,790,733.06
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	42,999.81	56,325.70
	银行间市场	-	-
	合计	42,999.81	56,325.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	103,501,889.48	128,305,948.43	24,804,058.95

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	738.45
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	32.58
应收债券利息	5.65
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	459.61
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	176.39
合计	1,412.68

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	55,194.40
银行间市场应付交易费用	-
合计	55,194.40

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	39.61
上市费	29,752.78
信息披露费	59,507.37
审计费用	24,795.19
合计	114,094.95

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,355,697.36	54,355,697.36
本期申购	12,288,133.23	12,288,133.23
本期赎回（以“-”号填列）	-11,787,235.33	-11,787,235.33
本期末	54,856,595.26	54,856,595.26

注：申购包含红利再投、基金转入的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

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	52,742,949.79	17,362,230.32	70,105,180.11
本期利润	11,257,275.73	3,437,578.63	14,694,854.36
本期基金份额交易产生的变动数	1,106,960.78	601,281.34	1,708,242.12
其中：基金申购款	13,603,869.44	5,177,095.65	18,780,965.09

基金赎回款	-12,496,908.66	-4,575,814.31	-17,072,722.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,107,186.30	21,401,090.29	86,508,276.59

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,386.70
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	592.28
其他	801.24
合计	14,780.22

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	63,045,142.91
减：卖出股票成本总额	51,551,796.76
买卖股票差价收入	11,493,346.15

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,988,778.29
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,950,585.00
减：应收利息总额	39,168.29
买卖债券差价收入	-975.00

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,127,213.60
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,127,213.60

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	3,437,578.63
——股票投资	3,424,252.74
——债券投资	13,325.89
——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	3,437,578.63

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	41,663.45
合计	41,663.45

注：本基金赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	190,231.14
银行间市场交易费用	-
合计	190,231.14

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
银行汇划费用	2,045.61

银行间账户维护费	18,000.00
上市费	29,752.78
其他费用	600.00
合计	134,700.95

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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、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、基金代销机构
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	3,523,209.40	3.05%	10,402,418.22	7.84%

##### 6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	3,281.19	3.05%	1,777.82	3.22%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	9,687.54	7.84%	3,456.43	8.87%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的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等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	939,435.48	770,503.38
其中：支付销售机构的客户维护费	241,956.78	238,108.22

注：支付基金管理人国投瑞银的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	156,572.65	128,417.23

注：支付基金托管人宁波银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回

购) 交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
期初持有的基金份额	5,075,634.52	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	5,075,634.52	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.25%	-

##### 6.4.10.4.2 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

于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020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	13,240,488.05	13,386.70	5,223,648.91	18,675.67

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股锁定	2.65	5.67	907,763.00	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-07-07	新股锁定	74.46	373.24	435.00	32,390.10	162,359.40	-
688201	信安世纪	2021-04-13	2021-10-21	新股锁定	26.78	45.41	1,338.00	35,831.64	60,758.58	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926.00	56,550.48	56,550.48	-
688667	菱电电控	2021-03-03	2021-09-13	新股锁定	75.42	103.88	470.00	35,447.40	48,823.60	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	1,091.00	42,385.35	42,385.35	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，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。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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、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)、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证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)。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。

#### 6.4.13.2 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。

本基金的基金管理人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本基金的托管人中国银行，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以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，违约风险可能性很小；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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日

AAA	-	-
AAA 以下	56,325.70	-
未评级	-	-
合计	56,325.70	-

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.债券投资以净价列示。

3.本基金上年度末未持有按长期信用评级列示的债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 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。

#### 6.4.13.3.1 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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 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。除附注 6.4.12.3 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同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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	13,240,488.05	-	-	-	13,240,488.05
结算备付金	80,373.06	-	-	-	80,373.06
存出保证金	16,559.16	-	-	-	16,559.16
交易性金融资产	-	56,325.70	-	128,249,622.73	128,305,948.43
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,412.68	1,412.68
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	105,209.47	105,209.47
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,337,420.27	56,325.70	-	128,356,244.88	141,749,990.85
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	20,023.66	20,023.66
应付管理人报酬	-	-	-	167,833.44	167,833.44
应付托管费	-	-	-	27,972.22	27,972.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	55,194.40	55,194.40
应交税费	-	-	-	0.33	0.33
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	114,094.95	114,094.95
负债总计	-	-	-	385,119.00	385,119.00
利率敏感度缺口	13,337,420.27	56,325.70	-	127,971,125.88	141,364,871.85
<b>上年度末</b>					
<b>2020年12月31日</b>	<b>1年以内</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	6,819,365.41	-	-	-	6,819,365.41
结算备付金	106,035.26	-	-	-	106,035.26
存出保证金	20,514.92	-	-	-	20,514.92
交易性金融资产	-	-	-	117,708,672.40	117,708,672.40
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融	-	-	-	-	-

资产					
应收证券清算款	-	-	-	379,045.94	379,045.94
应收利息	-	-	-	1,110.24	1,110.24
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	7,763.41	7,763.41
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,945,915.59	-	-	118,096,591.99	125,042,507.58
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	183,616.86	183,616.86
应付管理人报酬	-	-	-	156,600.30	156,600.30
应付托管费	-	-	-	26,100.02	26,100.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	44,937.94	44,937.94
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	170,374.99	170,374.99
负债总计	-	-	-	581,630.11	581,630.11
利率敏感度缺口	6,945,915.59	-	-	117,514,961.88	124,460,877.47

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 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 0.04%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	128,249,622.73	90.72	117,708,672.40	94.57
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	56,325.70	0.04	-	-
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	128,305,948.43	90.76	117,708,672.40	94.57

#### 6.4.13.4.3.2 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	基金业绩比较基准增加 5%	8,872,778.20	12,363,072.34
	基金业绩比较基准减少 5%	-8,872,778.20	-12,363,072.34

注：基金业绩比较基准 = 沪深 300 指数收益率 × 50% + 中债综合指数收益率 × 50%。

#### 6.4.14 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	128,249,622.73	90.48
	其中：股票	128,249,622.73	90.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	56,325.70	0.04
	其中：债券	56,325.70	0.04

	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	13,320,861.11	9.40
8	其他各项资产	123,181.31	0.09
9	合计	141,749,990.85	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。

## 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	-	-
B	采矿业	18,761,416.00	13.27
C	制造业	65,071,237.40	46.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,151,678.21	3.64
E	建筑业	11,014.44	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,189,850.98	4.38
J	金融业	15,902,405.10	11.25
K	房地产业	6,628,748.25	4.69
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	10,533,272.35	7.45
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	128,249,622.73	90.72

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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。

### 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	002831	裕同科技	366,619.00	10,884,918.11	7.70
2	603877	太平鸟	190,099.00	10,147,484.62	7.18
3	601601	中国太保	338,600.00	9,809,242.00	6.94
4	000603	盛达资源	704,500.00	8,869,655.00	6.27
5	603816	顾家家居	112,900.00	8,724,912.00	6.17
6	603583	捷昌驱动	143,672.00	7,272,676.64	5.14
7	600036	招商银行	111,800.00	6,058,442.00	4.29
8	300416	苏试试验	260,359.00	5,962,221.10	4.22
9	600988	赤峰黄金	395,500.00	5,928,545.00	4.19
10	002891	中宠股份	135,684.00	5,563,044.00	3.94
11	600905	三峡能源	907,763.00	5,147,016.21	3.64
12	002968	新大正	107,475.00	4,680,536.25	3.31
13	603018	华设集团	574,975.00	4,571,051.25	3.23
14	300642	透景生命	39,400.00	3,380,914.00	2.39

15	300673	佩蒂股份	128,515.0 0	2,860,743.90	2.02
16	688023	安恒信息	11,281.00	2,842,812.00	2.01
17	300408	三环集团	52,700.00	2,235,534.00	1.58
18	601899	紫金矿业	229,400.0 0	2,222,886.00	1.57
19	300628	亿联网络	25,900.00	2,170,420.00	1.54
20	002212	天融信	104,400.0 0	2,063,988.00	1.46
21	600741	华域汽车	74,900.00	1,967,623.00	1.39
22	001914	招商积余	113,400.0 0	1,948,212.00	1.38
23	600745	闻泰科技	18,600.00	1,802,340.00	1.27
24	000975	银泰黄金	183,000.0 0	1,740,330.00	1.23
25	600038	中直股份	30,300.00	1,598,022.00	1.13
26	002078	太阳纸业	118,700.0 0	1,584,645.00	1.12
27	002241	歌尔股份	36,400.00	1,555,736.00	1.10
28	603337	杰克股份	55,200.00	1,475,496.00	1.04
29	688111	金山办公	3,065.00	1,210,062.00	0.86
30	600201	生物股份	60,700.00	1,059,215.00	0.75
31	688617	惠泰医疗	435.00	162,359.40	0.11
32	688601	力芯微	728.00	134,024.80	0.09
33	688161	威高骨科	918.00	97,353.90	0.07
34	688308	欧科亿	1,413.00	95,759.01	0.07
35	688201	信安世纪	1,338.00	60,758.58	0.04
36	688239	航宇科技	4,926.00	56,550.48	0.04
37	688667	菱电电控	470.00	48,823.60	0.03
38	688499	利元亨	1,091.00	42,385.35	0.03
39	688658	悦康药业	1,752.00	39,402.48	0.03
40	688367	工大高科	1,717.00	37,035.69	0.03
41	601528	瑞丰银行	2,230.00	34,721.10	0.02
42	001207	联科科技	682.00	22,581.02	0.02
43	001206	依依股份	321.00	20,389.92	0.01
44	688226	威腾电气	2,693.00	17,289.06	0.01
45	001208	华菱线缆	1,754.00	13,558.42	0.01
46	603171	税友股份	637.00	12,230.40	0.01
47	605287	德才股份	349.00	11,014.44	0.01
48	605011	杭州热电	525.00	4,662.00	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	600988	赤峰黄金	6,619,420.92	5.32
2	000603	盛达资源	5,477,695.44	4.40
3	002891	中宠股份	4,020,944.60	3.23
4	300673	佩蒂股份	3,663,825.90	2.94
5	600905	三峡能源	3,436,527.95	2.76
6	601601	中国太保	3,225,958.58	2.59
7	688023	安恒信息	2,869,203.93	2.31
8	002212	天融信	2,064,970.00	1.66
9	300408	三环集团	1,968,962.00	1.58
10	000002	万科 A	1,906,127.00	1.53
11	002343	慈文传媒	1,737,875.00	1.40
12	000975	银泰黄金	1,686,575.00	1.36
13	603583	捷昌驱动	1,681,619.00	1.35
14	600038	中直股份	1,621,527.00	1.30
15	603816	顾家家居	1,588,757.00	1.28
16	002241	歌尔股份	1,363,629.00	1.10
17	300642	透景生命	1,329,851.00	1.07
18	002968	新大正	1,237,465.00	0.99
19	603786	科博达	986,404.00	0.79
20	002831	裕同科技	985,775.00	0.79

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	000725	京东方 A	5,964,993.00	4.79
2	300673	佩蒂股份	5,727,206.00	4.60
3	002597	金禾实业	4,184,457.40	3.36
4	603228	景旺电子	3,568,662.40	2.87
5	300750	宁德时代	2,906,923.00	2.34
6	300633	开立医疗	2,243,980.64	1.80
7	603816	顾家家居	2,242,267.00	1.80

8	603259	药明康德	2,133,751.00	1.71
9	600036	招商银行	2,046,257.80	1.64
10	300558	贝达药业	2,004,435.83	1.61
11	300136	信维通信	1,930,022.00	1.55
12	002993	奥海科技	1,853,404.51	1.49
13	600905	三峡能源	1,797,364.80	1.44
14	000002	万科 A	1,758,073.00	1.41
15	002938	鹏鼎控股	1,751,143.01	1.41
16	002343	慈文传媒	1,603,191.00	1.29
17	601318	中国平安	1,565,261.00	1.26
18	688023	安恒信息	1,487,784.10	1.20
19	603786	科博达	1,186,462.00	0.95
20	002050	三花智控	1,112,411.00	0.89

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	58,668,494.35
卖出股票的收入（成交）总额	63,045,142.91

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	-	-
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）	56,325.70	0.04

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	56,325.70	0.04

## 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	127036	三花转债	430	56,325.70	0.04

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.10.2 本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，通过股指期货就本基金投资组合进行及时、有效地调整，并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

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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，适度运用国债期货。本基金利用国债期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过国债期货提高投资组合的运作效率。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 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“招商银行”，根据中国银行保险监督管理委员会（以下简称“中国银保监会”）银保监罚决字【2021】16号，招商银行股份有限公司因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等违法违规行为，被中国银保监会罚款合计 7170 万元。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	16,559.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,412.68
5	应收申购款	105,209.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	123,181.31

#### 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不存在流动受限情况。

#### 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

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
3,420	16,039.94	12,725,984.73	23.20%	42,130,610.53	76.80%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	严炯	725,200.00	12.93%
2	王星	300,011.00	5.35%
3	宋春	296,014.00	5.28%
4	钱凤春	200,009.00	3.57%
5	柳红	200,007.00	3.57%
6	李超	197,040.00	3.51%

7	陈惠青	186,836.00	3.33%
8	沈牧	150,000.00	2.67%
9	刘剑新	130,000.00	2.32%
10	许泽荣	119,900.00	2.14%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,218,811.74	4.04%

### 8.4 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 19 日）基金份额总额	1,377,739,275.28
本报告期期初基金份额总额	54,355,697.36
本报告期基金总申购份额	12,288,133.23
减：本报告期基金总赎回份额	11,787,235.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	54,856,595.26

## 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 2021 年 6 月 25 日起，刘凯先生不再担任公司副总经理。

### 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普华永道中天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	
西藏东方财富	1	15,008,179.96	12.98%	13,977.04	12.98%	-
中泰证券	3	14,743,218.20	12.75%	13,730.36	12.75%	-
华西证券	2	14,022,034.00	12.13%	13,058.93	12.13%	-
中信建投	2	7,853,356.63	6.79%	7,313.47	6.79%	-
兴业证券	1	7,521,293.53	6.50%	7,004.97	6.50%	-
东方证券	3	7,433,863.00	6.43%	6,923.11	6.43%	-
长江证券	1	7,307,952.94	6.32%	6,805.71	6.32%	-
天风证券	1	6,028,084.60	5.21%	5,613.95	5.21%	-
开源证券	1	5,658,450.76	4.89%	5,269.85	4.89%	-
国泰君安	1	5,248,837.93	4.54%	4,888.25	4.54%	-
国信证券	1	4,756,738.83	4.11%	4,429.98	4.11%	-
东北证券	2	4,378,924.73	3.79%	4,078.09	3.79%	-
中信证券	2	3,808,412.24	3.29%	3,546.81	3.29%	-
安信证券	1	3,523,209.40	3.05%	3,281.19	3.05%	-
国元证券	1	1,603,578.64	1.39%	1,493.42	1.39%	-

渤海证券	1	1,464,828.83	1.27%	1,364.14	1.27%	-
信达证券	1	1,148,207.38	0.99%	1,069.36	0.99%	-
东亚前海证 券	1	1,098,315.00	0.95%	1,022.96	0.95%	-
中金公司	1	985,479.39	0.85%	917.73	0.85%	-
申万宏源证 券	1	675,258.00	0.58%	628.88	0.58%	-
广发证券	1	505,511.84	0.44%	470.77	0.44%	-
太平洋证券	1	422,813.00	0.37%	393.75	0.37%	-
野村东方国 际证券	1	310,474.27	0.27%	289.14	0.27%	-
东兴证券	1	122,774.70	0.11%	114.35	0.11%	-

### 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
中信建投	1,949,610.00	49.99%	-	-	-	-
开源证券	1,950,585.00	50.01%	-	-	-	-

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、本基金报告期内新增东亚前海证券 1 个席位，新增信达证券 1 个席位，新增野村东方国际证券 1 个席位，退租国都证券 1 个席位，退租国联证券 1 个席位，退租万和证券 1 个席位

### 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对本基金持有的盛达资源进行估值调整	上海证券报, 中国证券报, 证券时报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-02-19
2	报告期内基金管理人调整旗下部分基金单笔最低申购（含定期定额投资）金额、单笔最低赎回份额及账户最低保留份额进行公告	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	2021-03-22
3	报告期内基金管理人调整对基金行业高级管理人员变更进行公告	证券时报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-06-26

## 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	
<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。

### 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

《关于准予国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]478 号）

《关于国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》（机构部函[2015]1422 号）

《国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

《国投瑞银瑞盈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

本报告期内在中国证监会规定媒介上披露的信息公告原文

国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2021 年中期报告原文

### 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

国投瑞银基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日