

**国投瑞银优化增强债券型证券投资基金**

**2022 年第 4 季度报告**

**2022 年 12 月 31 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：二〇二三年一月十九日**

## §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 1 月 18 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 2022 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 国投瑞银优化增强债券  |
| 基金主代码      | 121012  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2010 年 9 月 8 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 8,668,273,505.46 份  |
| 投资目标       | 在追求基金资产稳定增值、有效控制风险和保持资金流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。                                     |
| 投资策略       | 1、资产配置<br>本基金采取稳健灵活的投资策略，通过固定收益类金融工具的主动管理，力求降低基金净值波动风险，并根据对股票市场的趋势研判及新股申购收益率预测，适度参与一级市场新股和增发新股的申购 |

|                 |   |                  |
|-----------------|---|------------------|
|                 | <p>以及二级市场的股票投资，力求提高基金总体收益率。</p> <p>2、债券投资管理</p> <p>本基金借鉴 UBS 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，注重挖掘债券收益率曲线期限结构与信用利差的变动趋势中隐含的投资机会，确定债券模拟组合，并管理组合风险。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金股票投资策略分为一级市场新股申购策略、二级市场股票投资策略和存托凭证投资策略。</p> |                  |
| 业绩比较基准          | 中债总指数收益率×90% + 沪深 300 指数收益率×10%   |                  |
| 风险收益特征          | 本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  |                  |
| 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称     | 国投瑞银优化增强债券 A/B  | 国投瑞银优化增强债券 C     |
| 下属分级基金的交易代码     | 121012（前端）、128012（后端）   | 128112           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 8,224,122,156.62 份  | 444,151,348.84 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 |
|--------|-----|

|                | (2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日) |                |
|----------------|------------------------------------|----------------|
|                | 国投瑞银优化增强债券 A/B                     | 国投瑞银优化增强债券 C   |
| 1.本期已实现收益      | 39,781,435.41                      | 2,429,385.58   |
| 2.本期利润         | 90,516,860.42                      | 4,654,975.57   |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0147                             | 0.0139         |
| 4.期末基金资产净值     | 11,412,979,469.15                  | 609,577,614.82 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.388                              | 1.372          |

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 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、国投瑞银优化增强债券 A/B:

| 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      | 1.12%   | 0.25%     | -0.12%     | 0.14%         | 1.24%   | 0.11% |
| 过去六个月      | -0.06%  | 0.23%     | -0.96%     | 0.12%         | 0.90%   | 0.11% |
| 过去一年       | -0.56%  | 0.27%     | -2.06%     | 0.14%         | 1.50%   | 0.13% |
| 过去三年       | 18.45%  | 0.28%     | 2.09%      | 0.15%         | 16.36%  | 0.13% |
| 过去五年       | 35.88%  | 0.25%     | 9.41%      | 0.14%         | 26.47%  | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 128.74% | 0.28%     | 13.27%     | 0.17%         | 115.47% | 0.11% |

##### 2、国投瑞银优化增强债券 C:

| 阶段 | 净值增长 | 净值增长 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①—③ | ②—④ |
|----|------|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|------|-----|-----|

|                    | 率①      | 率标准差<br>② | 基准收益<br>率③ | 基准收益<br>率标准差<br>④ |         |       |
|--------------------|---------|-----------|------------|-------------------|---------|-------|
| 过去三个月              | 0.95%   | 0.25%     | -0.12%     | 0.14%             | 1.07%   | 0.11% |
| 过去六个月              | -0.31%  | 0.23%     | -0.96%     | 0.12%             | 0.65%   | 0.11% |
| 过去一年               | -1.05%  | 0.27%     | -2.06%     | 0.14%             | 1.01%   | 0.13% |
| 过去三年               | 16.93%  | 0.28%     | 2.09%      | 0.15%             | 14.84%  | 0.13% |
| 过去五年               | 33.42%  | 0.25%     | 9.41%      | 0.14%             | 24.01%  | 0.11% |
| 自基金合<br>同生效起<br>至今 | 118.31% | 0.28%     | 13.27%     | 0.17%             | 105.04% | 0.11% |

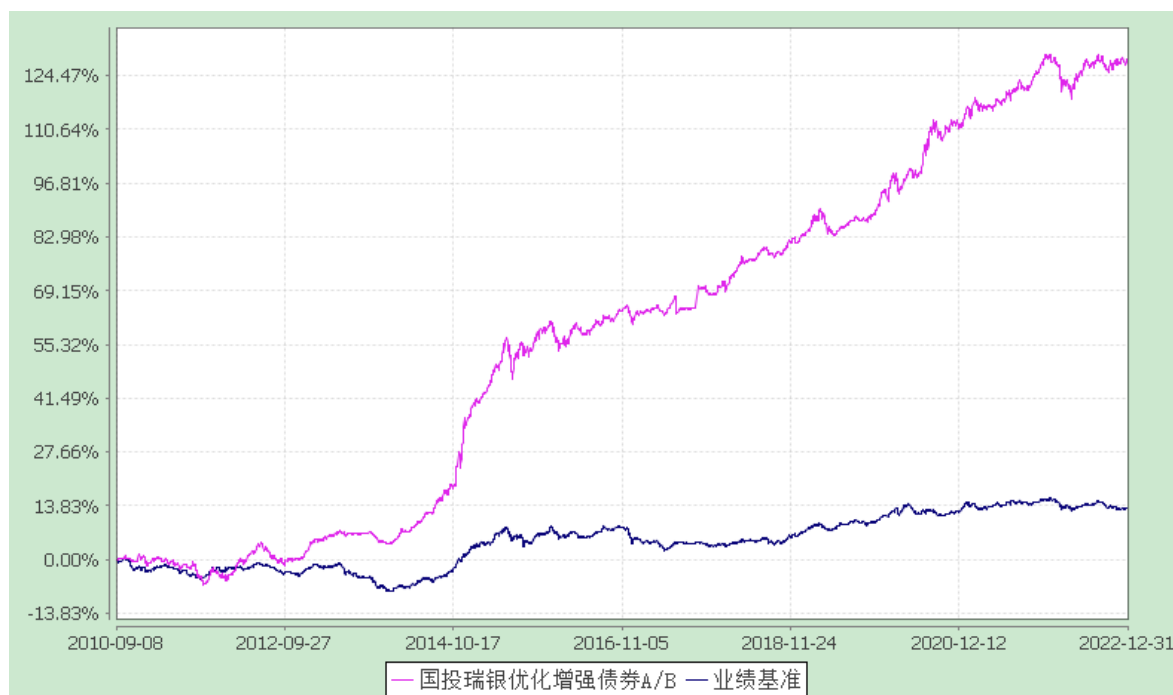
注：1、本基金以中债总指数收益率×90%+沪深300 指数收益率×10%作为业绩比较基准。中债总指数是由中债金融估值中心有限公司编制的中国债券指数。该指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的主要固定收益类证券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。沪深300指数是由中证指数公司开发的中国A股市场统一指数,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票，能够反映A股市场总体发展趋势，具有权威性，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

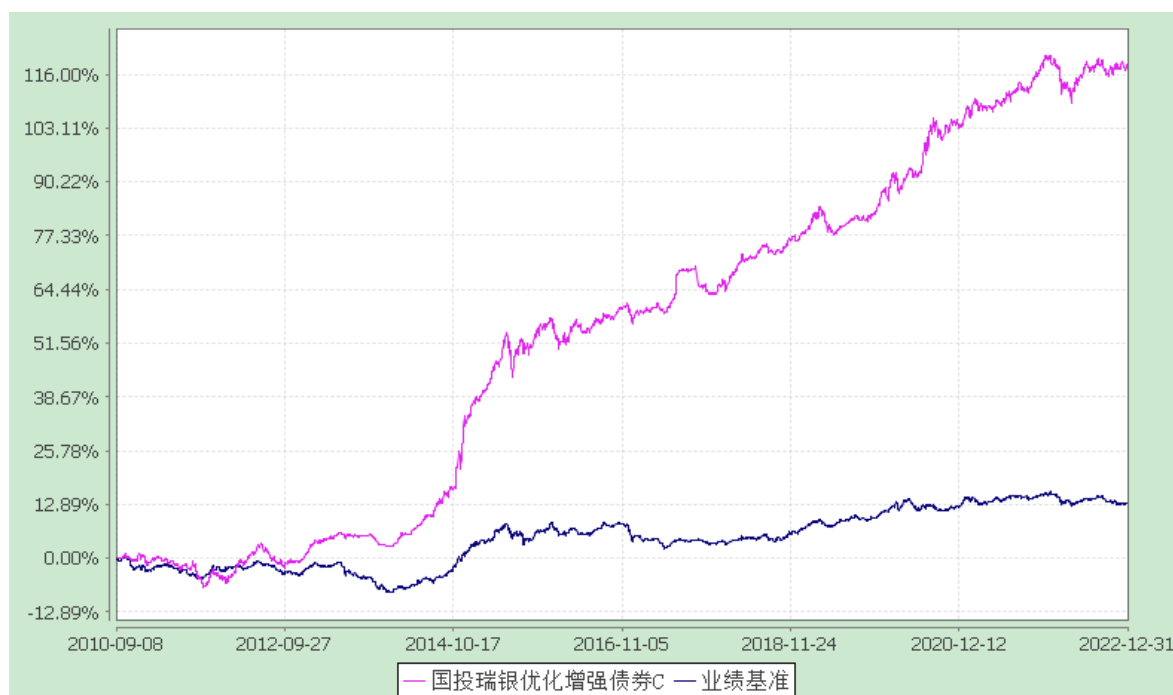
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国投瑞银优化增强债券型证券投资基金  
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  
(2010 年 9 月 8 日至 2022 年 12 月 31 日)

1. 国投瑞银优化增强债券 A/B:



2. 国投瑞银优化增强债券 C:



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的3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 | 2020-07-10  | -    | 9      | 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、国投瑞银信息消费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）、国投瑞银锐意改革灵活配置混合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。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）、国投瑞银美丽中国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新兴产业混合型证券投资基金(LOF)基金经理。 |
| 杨枫 | 本基金基金经理         | 2021-08-05  | -    | 10     | 中国籍，硕士，具有基金从业资格。2013 年 7 月至 2021 年 5 月期间历任上海东方证券资产管理有限公司固定收益部研究员、私募权益投资部投资   |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 支持经理历、投资主办人、公募指数与多策略部投资经理。2021 年 6 月加入国投瑞银基金管理有限公司固定收益部。现任国投瑞银顺成 3 个月定期开放债券型证券投资基金、国投瑞银优化增强债券型证券投资基金、国投瑞银融华债券型证券投资基金及国投瑞银瑞祥灵活配置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

2022 四季度，地产纾困政策加码叠加防疫政策放松导致债券市场出现下跌。与此同时，银行理财产品净值下跌引发的赎回潮进一步加剧了债市下跌的幅度，交易结构层面的冲击使得不同期限、不同券种的跌幅出现明显分化，中短久期、信用品种的下跌幅度更大，而长久期利率债相对跌幅较小。信用利差扩大叠加银行理财规模收缩也对转债品种整体估值形成压制。本基金在下跌过程中增持了短久期高等级信用债，利用货币市场超常规宽松的窗口期提高了组合杠杆率，增厚收益。权益方面，报告期内上证指数上涨 2.14%，创业板指数上涨 2.53%。白酒、房地产、消费者服务等偏消费及经济周期相关的板块表现出色，而之前较为抗跌的煤炭石化化工及新能源等表现较弱。

##### 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 1.388 元，C 级份额净值为 1.372 元，本报告期 A 级份额净值增长率为 1.12%，C 级份额净值增长率为 0.95%，同期业绩比较基准收益率为-0.12%。

#### 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   | 2,390,799,410.40  | 16.15        |
|    | 其中：股票  | 2,390,799,410.40  | 16.15        |
| 2  | 固定收益投资 | 12,277,672,997.15 | 82.94        |
|    | 其中：债券  | 12,277,672,997.15 | 82.94        |

|   |                   |                   |        |
|---|-------------------|-------------------|--------|
|   | 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          | 32,996,746.49     | 0.22   |
|   | 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      | 78,785,528.56     | 0.53   |
| 7 | 其他各项资产            | 22,456,274.42     | 0.15   |
| 8 | 合计                | 14,802,710,957.02 | 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              | 47,091,208.00    | 0.39         |
| C  | 制造业              | 1,256,180,321.91 | 10.45        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 571,689,093.44   | 4.76         |
| E  | 建筑业              | -                | -            |
| F  | 批发和零售业           | -                | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 33,624,868.48    | 0.28         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 22,131,846.00    | 0.18         |
| J  | 金融业              | 111,558,265.74   | 0.93         |
| K  | 房地产业             | 41,307,303.00    | 0.34         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -                | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 307,216,503.83   | 2.56         |
| 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            | 2,390,799,410.40 | 19.89 |

### 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  | 300750 | 宁德时代 | 897,013.00    | 352,902,854.46 | 2.94         |
| 2  | 601985 | 中国核电 | 53,359,293.00 | 320,155,758.00 | 2.66         |
| 3  | 603816 | 顾家家居 | 6,496,670.00  | 277,472,775.70 | 2.31         |
| 4  | 002831 | 裕同科技 | 7,432,824.00  | 245,803,489.68 | 2.04         |
| 5  | 603018 | 华设集团 | 17,730,832.00 | 134,399,706.56 | 1.12         |
| 6  | 600036 | 招商银行 | 2,994,049.00  | 111,558,265.74 | 0.93         |
| 7  | 002475 | 立讯精密 | 3,415,400.00  | 108,438,950.00 | 0.90         |
| 8  | 300416 | 苏试试验 | 3,407,397.00  | 102,733,019.55 | 0.85         |
| 9  | 600011 | 华能国际 | 12,891,284.00 | 98,102,671.24  | 0.82         |
| 10 | 601965 | 中国汽研 | 3,616,294.00  | 70,083,777.72  | 0.58         |

### 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      | 284,006,520.55   | 2.36         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 3,312,281,057.82 | 27.55        |
|    | 其中：政策性金融债 | 2,652,673,913.72 | 22.06        |
| 4  | 企业债券      | 1,976,688,374.85 | 16.44        |
| 5  | 企业短期融资券   | 616,696,455.88   | 5.13         |
| 6  | 中期票据      | 2,947,513,861.35 | 24.52        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,111,010,621.78 | 9.24         |

|    |      |                   |        |
|----|------|-------------------|--------|
| 8  | 同业存单 | -                 | -      |
| 9  | 其他   | 2,029,476,104.92  | 16.88  |
| 10 | 合计   | 12,277,672,997.15 | 102.12 |

**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  | 210203 | 21 国开 03 | 6,650,000 | 696,776,979.45 | 5.80         |
| 2  | 220304 | 22 进出 04 | 3,000,000 | 303,865,890.41 | 2.53         |
| 3  | 220408 | 22 农发 08 | 3,000,000 | 300,550,273.97 | 2.50         |
| 4  | 220203 | 22 国开 03 | 2,900,000 | 295,417,041.10 | 2.46         |
| 5  | 200212 | 20 国开 12 | 2,500,000 | 258,861,917.81 | 2.15         |

**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中，持有“21 国开 03”、“22 国开 03”、“20 国开 12”，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【2022】8 号，国家开发银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在未报送

逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据等违法违规行为，被银保监会罚款 440 万元。持有“22 进出 04”，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【2022】9 号，中国进出口银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据等违法违规行为，被银保监会罚款 420 万元。持有“22 农发 08”，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【2022】10 号，中国农业发展银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在漏报不良贷款余额 EAST 数据等违法违规行为，被银保监会罚款 480 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。

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   | 474,933.35    |
| 2  | 应收证券清算款 | 4,789,083.54  |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 17,013,514.76 |
| 6  | 其他应收款   | 178,742.77    |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 22,456,274.42 |

### 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  | 110059 | 浦发转债     | 167,886,684.93 | 1.40 |
| 2  | 113042 | 上银转债     | 165,896,710.14 | 1.38 |
| 3  | 113021 | 中信转债     | 142,749,687.67 | 1.19 |
| 4  | 113044 | 大秦转债     | 78,788,281.85  | 0.66 |
| 5  | 132018 | G 三峡 EB1 | 74,635,773.17  | 0.62 |
| 6  | 110053 | 苏银转债     | 56,553,533.83  | 0.47 |
| 7  | 113037 | 紫银转债     | 37,301,950.41  | 0.31 |
| 8  | 113057 | 中银转债     | 24,434,131.88  | 0.20 |
| 9  | 110063 | 鹰 19 转债  | 21,892,862.47  | 0.18 |
| 10 | 110079 | 杭银转债     | 20,257,795.56  | 0.17 |
| 11 | 110085 | 通 22 转债  | 18,119,897.56  | 0.15 |
| 12 | 127012 | 招路转债     | 18,101,395.72  | 0.15 |
| 13 | 127045 | 牧原转债     | 16,859,513.77  | 0.14 |
| 14 | 123107 | 温氏转债     | 14,580,835.68  | 0.12 |
| 15 | 110082 | 宏发转债     | 14,445,627.67  | 0.12 |
| 16 | 110057 | 现代转债     | 14,281,271.67  | 0.12 |
| 17 | 127040 | 国泰转债     | 12,521,351.53  | 0.10 |
| 18 | 128111 | 中矿转债     | 11,352,319.89  | 0.09 |
| 19 | 127061 | 美锦转债     | 10,841,470.26  | 0.09 |
| 20 | 113602 | 景 20 转债  | 10,315,074.95  | 0.09 |
| 21 | 128141 | 旺能转债     | 9,123,157.50   | 0.08 |
| 22 | 128119 | 龙大转债     | 8,981,616.25   | 0.07 |
| 23 | 127032 | 苏行转债     | 8,964,181.43   | 0.07 |
| 24 | 110080 | 东湖转债     | 8,784,896.72   | 0.07 |
| 25 | 113058 | 友发转债     | 8,563,185.61   | 0.07 |
| 26 | 110083 | 苏租转债     | 8,181,067.50   | 0.07 |
| 27 | 113045 | 环旭转债     | 7,884,535.41   | 0.07 |
| 28 | 127006 | 敖东转债     | 7,734,858.64   | 0.06 |
| 29 | 128081 | 海亮转债     | 7,418,308.07   | 0.06 |
| 30 | 127020 | 中金转债     | 7,413,396.19   | 0.06 |
| 31 | 127035 | 濮耐转债     | 6,424,201.50   | 0.05 |
| 32 | 127063 | 贵轮转债     | 6,380,362.40   | 0.05 |
| 33 | 123145 | 药石转债     | 6,367,605.19   | 0.05 |
| 34 | 128121 | 宏川转债     | 5,960,822.92   | 0.05 |
| 35 | 113054 | 绿动转债     | 5,878,208.93   | 0.05 |
| 36 | 123133 | 佩蒂转债     | 5,779,938.30   | 0.05 |
| 37 | 110045 | 海澜转债     | 5,625,800.53   | 0.05 |
| 38 | 128144 | 利民转债     | 5,611,469.16   | 0.05 |
| 39 | 132022 | 20 广版 EB | 5,252,695.89   | 0.04 |
| 40 | 110086 | 精工转债     | 4,789,584.63   | 0.04 |
| 41 | 127033 | 中装转 2    | 4,342,074.30   | 0.04 |
| 42 | 113017 | 吉视转债     | 4,153,934.25   | 0.03 |
| 43 | 110074 | 精达转债     | 3,743,323.21   | 0.03 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 44 | 128134 | 鸿路转债 | 3,601,024.31 | 0.03 |
| 45 | 123132 | 回盛转债 | 2,527,954.66 | 0.02 |
| 46 | 113641 | 华友转债 | 1,839,440.58 | 0.02 |

### 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             | 国投瑞银优化增强<br>债券A/B | 国投瑞银优化增强<br>债券C |
|----------------|-------------------|-----------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 4,346,436,818.34  | 303,342,320.48  |
| 报告期期间基金总申购份额   | 5,332,678,935.00  | 195,863,102.37  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 1,454,993,596.72  | 55,054,074.01   |
| 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   | 8,224,122,156.62  | 444,151,348.84  |

## §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 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金 |
|----|----------------|----------|
|----|----------------|----------|

| 者类别 |    |                                     |                |                  |               | 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  | 20221205-20221221,20221226-20221229 | 297,975,290.37 | 1,486,348,182.54 | 56,116,722.78 | 1,728,206,750.13 | 19.94% |

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。

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优化增强债券型证券投资基金暂停/恢复大额申购（转换转入、定期定额投资）公告，规定媒介公告时间为 2022 年 11 月 25 日。

2、报告期内管理人发布了关于旗下部分开放式基金转换业务的公告，规定媒介公告时间为 2022 年 12 月 2 日。

3、报告期内管理人发布了关于国投瑞银优化增强债券型证券投资基金分红公告，规定媒介公告时间为 2022 年 12 月 19 日。



## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

《关于核准国投瑞银优化增强债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2010]888 号）

《关于国投瑞银优化增强债券型证券投资基金备案确认的函》（基金部函[2010]531 号）

《国投瑞银优化增强债券型证券投资基金基金合同》

《国投瑞银优化增强债券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金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层

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：400-880-6868、0755-83160000

国投瑞银基金管理有限公司

二〇二三年一月十九日