

**国投瑞银瑞泰多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）**

**2019 年第 3 季度报告**

**2019 年 9 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：中国工商银行股份有限公司**

**报告送出日期：二〇一九年十月二十三日**

## §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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 22 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 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|        |  |
|--------|--|
| 基金简称   | 国投瑞银瑞泰多策略混合（LOF）   |
| 场内简称   | 国投瑞泰   |
| 基金主代码  | 161233   |
| 交易代码   | 161233   |
| 基金运作方式 | 契约型基金。国投瑞银瑞泰定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效后，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，国投瑞银瑞泰定增灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金（LOF），并更名为国投瑞银瑞泰多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF），投资人可在国投瑞银瑞泰多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的开放日办理申购和赎回业务。 |

|            |   |
|------------|---|
| 基金合同生效日    | 2017 年 1 月 23 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 176,021,503.39 份  |
| 投资目标       | <p>在封闭期内，在有效控制风险的前提下，本基金主要投资于定向增发证券，力争基金资产的持续稳健增值。转为上市开放式基金（LOF）后，在有效控制风险的前提下，本基金通过灵活运用多种投资策略，力争实现基金资产的持续稳健增值。</p>  |
| 投资策略       | <p>本基金的投资策略包括类别资产配置策略、定向增发投资策略、股票精选策略、主题投资策略、事件驱动策略、债券投资策略、衍生品投资策略等。</p> <p>（一）类别资产配置策略</p> <p>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>1、定向增发投资策略</p> <p>在封闭期内，本基金将主要采用定向增发投资策略；</p> <p>2、转为上市开放式基金（LOF）后，本基金将灵活采用多种策略进行股票投资，包括：行业配置策略、优选个股策略、主题投资策略及事件驱动策略。</p> <p>（三）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> <p>债券投资策略主要包括：久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略和个券选择策略。在不同的时期，采用以上策略对组合收益和风险的贡献不尽相同，</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>具体采用何种策略取决于债券组合允许的风险程度。</p> <p>（四）衍生品投资策略</p> <p>1、股指期货投资策略</p> <p>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</p> <p>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> <p>（五）权证投资管理</p> <p>1、考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素，估计权证合理价值。</p> <p>2、根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即“估值差价(Value Price)”以及权证合理价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理价值考量，决策买入、持有或沽出权证。</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。  |
| 基金管理人  | 国投瑞银基金管理有限公司  |
| 基金托管人  | 中国工商银行股份有限公司  |

### §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                              |
|----------------|----------------------------------|
|                | (2019 年 7 月 1 日-2019 年 9 月 30 日) |
| 1.本期已实现收益      | -14,084,290.08                   |
| 2.本期利润         | -793,932.23                      |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0048                          |
| 4.期末基金资产净值     | 188,039,906.74                   |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0683                           |

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

| 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 | -0.38% | 0.59%     | 0.16%      | 0.48%         | -0.54% | 0.11% |

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。中债综合指数由中债金融估值中心编制，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指数和中债综合指数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

国投瑞银瑞泰多策略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历史走势对比图

(2017 年 1 月 23 日至 2019 年 9 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 |        |                          |
| 杨冬冬 | 本基金基金经理 | 2017-01-23  | -    | 11     | 中国籍，硕士，具有基金从业资格。2008 年 4 |

|    |               |            |   |   |  |
|----|---------------|------------|---|---|--|
|    | 金经理, 基金投资部副总监 |            |   |   | 月加入国投瑞银。曾任国投瑞银瑞利灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银融华债券型证券投资基金及国投瑞银瑞盛灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。现任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)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。  |
| 吴潇 | 本基金基金经理       | 2017-03-01 | - | 5 | 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, 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及国投瑞银新收益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)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。 |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------|

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遵规守信情况的说明

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《国投瑞银瑞泰多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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

2019 年三季度，贸易摩擦带来的负面影响开始显现，各项经济数据出现明显的下行趋势。货币整体偏松，基建略有抬头。市场整体表现平稳，对贸易战的



反复已经充分预期。以 5G、苹果&华为产业链和自主可控为代表的科技股表现突出，房地产周期产业链依然受到压制。

报告期内，组合进行了调整，减少了对电子、军工的配置，加大了对商贸零售、新能源配置。

展望后市，世界经济受到贸易战的影响而放缓，美联储的重新回到降息的周期给新兴市场的货币有了更多的空间。随着中美贸易谈判可能将在 4 季度迎来新的转折，未来市场将更加关注新的大国关系下，不同行业利益的重新分配。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0683 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.38%，同期业绩比较基准收益率为 0.16%。

## §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              | 79,047,933.17 | 41.90        |
|    | 其中：股票             | 79,047,933.17 | 41.90        |
| 2  | 固定收益投资            | 79,834,100.00 | 42.32        |
|    | 其中：债券             | 79,834,100.00 | 42.32        |
|    | 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      | 27,220,226.89 | 14.43        |
| 7  | 其他各项资产            | 2,559,362.79  | 1.36         |

|   |    |                |        |
|---|----|----------------|--------|
| 8 | 合计 | 188,661,622.85 | 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。

## 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              | 2,703,420.00  | 1.44         |
| C  | 制造业              | 29,043,890.99 | 15.45        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 10,758,678.00 | 5.72         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,718,963.00  | 1.45         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 3,266,465.00  | 1.74         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 223,129.40    | 0.12         |
| J  | 金融业              | 24,757,871.74 | 13.17        |
| 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       | 5,575,515.04  | 2.97         |
| 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               | 79,047,933.17 | 42.04        |

### 5.2.2 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。

## 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  | 601288 | 农业银行 | 3,573,400.00 | 12,363,964.00 | 6.58         |
| 2  | 601933 | 永辉超市 | 1,210,200.00 | 10,758,678.00 | 5.72         |
| 3  | 601336 | 新华保险 | 214,962.00   | 10,462,200.54 | 5.56         |
| 4  | 603018 | 中设集团 | 479,408.00   | 5,575,515.04  | 2.97         |
| 5  | 300416 | 苏试试验 | 145,100.00   | 3,626,049.00  | 1.93         |
| 6  | 600612 | 老凤祥  | 70,091.00    | 3,435,159.91  | 1.83         |
| 7  | 600754 | 锦江酒店 | 141,100.00   | 3,266,465.00  | 1.74         |
| 8  | 603659 | 璞泰来  | 54,500.00    | 2,790,400.00  | 1.48         |
| 9  | 600760 | 中航沈飞 | 89,000.00    | 2,759,000.00  | 1.47         |
| 10 | 300037 | 新宙邦  | 107,600.00   | 2,724,432.00  | 1.45         |

#### 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      | 19,203,100.00 | 10.21        |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | 60,631,000.00 | 32.24        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 79,834,100.00 | 42.46        |

#### 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  | 101801128 | 18 国电 | 100,000 | 10,235,000.00 | 5.44         |

|   |           |                 |         |               |      |
|---|-----------|-----------------|---------|---------------|------|
|   |           | MTN002          |         |               |      |
| 2 | 101900602 | 19 汇金<br>MTN007 | 100,000 | 10,125,000.00 | 5.38 |
| 3 | 101552011 | 15 三峡<br>MTN002 | 100,000 | 10,113,000.00 | 5.38 |
| 4 | 101900369 | 19 南电<br>MTN004 | 100,000 | 10,109,000.00 | 5.38 |
| 5 | 122052    | 10 石化 02        | 100,000 | 10,060,000.00 | 5.35 |

## 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

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 5.9.2 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合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。

## 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

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。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，以达到风险管理的目标。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 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“新华保险”市值 1,046,200.54 元，占基金资产净值 5.56%。根据中国保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监保罚决字〔2018〕1 号），新华保险股份有限公司因欺骗投保人、编制提供虚假资料、未按照规定使用经批准或备案的保险费率等行为，被中国保险监督管理委员会分别罚款 30 万元、罚款 50 万元、罚款 30 万元。基金管理人认为，该公司上述被处罚事项有利于公司加强内部管理，公司当前总体生产经营和财务状况保持稳定，事件对该公司经营活动未产生实质性影响，不改变该公司基本面。

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   | 43,843.92    |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,362,297.48 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 1,152,924.95 |
| 5  | 应收申购款   | 296.44       |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |

|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 9 | 合计 | 2,559,362.79 |
|---|----|--------------|

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末股票投资不存在流通受限情况。

#### 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

|              |                |
|--------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 165,454,357.82 |
| 报告期基金总申购份额   | 20,986,306.55  |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 10,419,160.98  |
| 报告期基金拆分变动份额  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额 | 176,021,503.39 |

### §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

单位：份

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 80,603,999.98 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -             |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -             |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 80,603,999.98 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 45.79         |

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期无运用固有资金投资本基金的交易明细。

## §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              | 20190701-20190930      | 50,001,250.00 | 0.00 | 0.00 | 50,001,250.00 | 28.41% |
|       | 2              | 20190701-20190930      | 80,603,999.98 | 0.00 | 0.00 | 80,603,999.98 | 45.79% |

#### 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、报告期内基金管理人就基金行业高级管理人员变更进行公告，指定媒介公告时间为2019年8月17日。

2、报告期内基金管理人就基金行业高级管理人员（首席信息官）任职进行公告，指定媒介公告时间为2019年9月5日。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

《关于准予国投瑞银瑞泰定增灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》  
（证监许可[2016]1722 号）

《关于国投瑞银瑞泰定增灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》（机  
构部函[2017]240 号）

《国投瑞银瑞泰定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

《国投瑞银瑞泰定增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指定信息披露报刊上披露的信息公告原文

国投瑞银瑞泰多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2019 年第 3 季  
度报告原文

### 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，也可按工本费购买复印件

咨询电话：400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一九年十月二十三日