

**国投瑞银国家安全灵活配置混合型证券投资基金**  
**2022 年中期报告**  
**2022 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：二〇二二年八月三十日

## 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 2022 年 8 月 26 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 2022 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>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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	10
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	11
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	12
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	12
<b>5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>7 投资组合报告</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	51
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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
<b>8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
8.3 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.....	53
<b>9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>10 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	56
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>56</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.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
<b>12 备查文件目录.....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	58

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国投瑞银国家安全灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国投瑞银国家安全混合
基金主代码	001838
交易代码	001838
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 2 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	2,646,215,209.75 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，本基金通过股票与债券等资产的合理配置，并精选国家安全主题的相关上市公司股票进行投资，力争基金资产的持续稳健增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要包括类别资产配置策略、股票投资管理策略、事件驱动策略、债券投资管理策略。</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>2、股票投资管理</p> <p>本基金通过对国家安全主题及相关行业进行深入细致的研究分析，秉承价值投资的理念，深入挖掘国家安全主题及其相关行业股票的投资价值，分享国家安全主题所带来的投资机会。构建股票组合的步骤是：界定国家安全主题及其相关行业并确定股票初选库；基于公司基本面全面考量、筛选优质企业，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、事件驱动策略</p> <p>本基金将持续关注国家安全主题的相关事件驱动投资机会，基金管理人重点关注的事件包括资产重组、资产注入、公司兼并收购、公司股权变动、公司再融资、上市公司管理层变动、公司股权激励计划、新产品研发与上市等等。</p> <p>4、债券投资管理</p>

	<p>本基金采取“自上而下”的债券分析方法，并结合对未来国家安全主题及相关行业的基本面研判，确定债券投资组合，并管理组合风险。</p> <p>5、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>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。
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	95566
	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		傅强	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的 管理人互联网网址	<a href="http://www.ubssdic.com">http://www.ubssdic.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	国投瑞银基金管理有限公司	深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层
--------	--------------	-----------------------------

### 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（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-298,810,053.03
本期利润	-718,367,393.92
加权平均基金份额本期利润	-0.2666
本期加权平均净值利润率	-23.02%
本期基金份额净值增长率	-17.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	53,734,809.36
期末可供分配基金份额利润	0.0203
期末基金资产净值	3,222,415,364.60
期末基金份额净值	1.218
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	33.98%

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	8.27%	2.13%	5.60%	0.64%	2.67%	1.49%

过去三个月	7.88%	2.50%	3.96%	0.86%	3.92%	1.64%
过去六个月	-17.50%	2.23%	-5.21%	0.87%	-12.29%	1.36%
过去一年	13.83%	2.21%	-7.66%	0.75%	21.49%	1.46%
过去三年	99.08%	2.13%	13.17%	0.76%	85.91%	1.37%
自基金合同生效起至今	33.98%	1.93%	20.00%	0.75%	13.98%	1.18%

注：1、本基金属于灵活配置混合型基金。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 指数和中债综合指数加权作为本基金的投资业绩评价基准，具体为沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。

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

国投瑞银国家安全灵活配置混合型证券投资基金  
 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 12 月 2 日至 2022 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 2022 年 6 月底，在公募基金方面，公司共管理 82 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		
李轩	本基金基金经理	2015-12-02	-	16	中国籍，硕士，具有基金从业资格。2005 年 3 月至 2006 年 3 月上海复星高科技集团产业投资公司分析师，2006 年 4 月至 2010 年 3 月任德邦证券研究员。2010 年 4 月加入国投瑞银基金管理有限公司研究部。曾任国投瑞银招财灵活配置混合型证券投资基金（原国投瑞银招财保本混合型证券投资基金）基金经理。现任国投瑞银国家安

					全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 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，管理人通过制度、流程和技术手段保证了公平交易原则的实现，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，形成了有效地公平交易体系。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。

报告期内，管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。本年度同向交易价差专项分析的情况如下：

1、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差的溢价率进行分析，对两两组合同向交易成交价格均值的溢价率是否趋近于零进行 T 检验，检验在 95% 的可信水平下，价格均值的溢价率趋近于零是否存在检验不通过的情况。

2、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差优劣进行比较，区分买优、卖优、买次、卖次等情况分别分析两两组合在期间内交易时是否存在显著优于另一方的异常情况，

3、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差区分两两组合进行利益输送的模拟测算，检查在过去四个季度内，是否存在显著异常的情况。

检验分析结果显示，公司管理的所有投资组合，在过去连续四个季度内未发现存在违反公平交易原则的情况。

#### 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 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

2022 年全国财政安排国防支出预算 14760.81 亿元，比上年预算执行数增长 7.1%，超过国内生产总值增长 5.5%的经济发展目标。自第 2 季度以来，中航工业集团增持旗下四家重要的军工上市公司股票，表明了该集团对这些公司股价可能低估的态度。根据公开新闻，一批核心军工企业第二季度收入过半任务过半。航空母舰福建舰下水预示着舰载航空兵的装备建设任重道远，是核心军工的一个发展方向。

本基金以持有核心军工股为主要策略，基金成立以来一直根据合同规定将主要资产投资于国防工业的核心军工股，坚持维持基金风格不漂移，摒弃没有业绩、没有高新军事技术支撑的军工概念股。国防工业高新武器装备投资研发周期很长，研究壁垒很高和长线资金匮乏导致股价波动大。所以中信国防军工指数波动性大，本基金跟随其波动。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.218 元，本基金份额净值增长率为-17.50%，同期业绩比较基准收益率为-5.21%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

根据中国商飞和波音公司预测，未来 20 年，我国对类似 C919 这类窄体客机的需求量为每年平均 300 架左右，假设未来 C919 在国内能够达到三分之一的市占率，则 C919 飞机年平均交付量有望达到 100 架。对民用航制造业前景较为乐观。据报道，国

务院国资委副主任翁杰明 5 月 18 日在深化国有控股上市公司改革争做国企改革三年行动表率专题推进会上表示：“要继续加大优质资产注入上市公司力度，集团公司要系统梳理未上市和已上市资源，结合实际逐步将现有未上市的优质资产有计划地注入上市公司，必要的也可单独上市”。所以我国国防工业中未上市优质资产还有相当可观的规模，我们对我国国防军工产业发展的前景相对乐观。

#### 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、运营部及相关职能部门。

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-298,810,053.03 元，期末可供分配利润为 53,734,809.36 元。报告期内本基金共实施 1 次收益分配，累计分配 316,742,326.60 元，每 10 份基金份额分红 1.29 元。

本报告期本基金的利润分配符合法律法规的相关规定和《基金合同》的约定。

#### 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”）在对国投瑞银国家安全灵活配置混合型证券投资基金（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：国投瑞银国家安全灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.8.1	178,990,816.63	229,703,735.33
结算备付金		6,355,885.35	5,908,743.50
存出保证金		890,827.54	2,679,503.99

交易性金融资产	6.4.8.2	3,042,431,363.39	3,848,205,814.05
其中：股票投资		3,039,365,663.83	3,848,205,814.05
基金投资		-	-
债券投资		3,065,699.56	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.8.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.8.4	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		14,982,061.41	85,902,902.45
应收股利		-	-
应收申购款		32,095,487.56	20,401,308.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.8.5	417,357.03	367,899.35
资产总计		3,276,163,798.91	4,193,169,906.89
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 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	6.4.8.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		6,211,997.29	-
应付赎回款		39,166,006.88	114,287,664.79
应付管理人报酬		3,820,096.02	5,137,443.46
应付托管费		636,682.68	856,240.60
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.8.6	3,913,651.44	6,727,219.28
负债合计		53,748,434.31	127,008,568.13
<b>净资产：</b>		-	-
实收基金	6.4.8.7	2,646,215,209.75	2,504,108,895.91
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.8.8	576,200,154.85	1,562,052,442.85
净资产合计		3,222,415,364.60	4,066,161,338.76
负债和净资产总计		3,276,163,798.91	4,193,169,906.89

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.218 元，基金份额总额 2,646,215,209.75 份。

（2）以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：资产负债表中上年度末的“其他资产”项目包含“应收利息”项目余额，“其他负债”项目包含“应付交易费用”及“应付利息”项目余额。

## 6.2 利润表

会计主体：国投瑞银国家安全灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-691,157,971.14</b>	<b>-1,022,895,139.01</b>
1.利息收入		438,996.57	1,235,406.63
其中：存款利息收入	6.4.8.9	438,996.57	1,168,962.79
债券利息收入		-	66,443.84
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）		-281,292,115.93	-1,304,155.28
其中：股票投资收益	6.4.8.10	-290,079,499.60	-21,897,042.78
基金投资收益	6.4.8.11	-	-
债券投资收益	6.4.8.12	12,119.82	-
资产支持证券投资收益	6.4.8.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.8.14	-	-
衍生工具收益	6.4.8.15	-	-
股利收益	6.4.8.16	8,775,263.85	20,592,887.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.8.17	-419,557,340.89	-1,075,703,584.08
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.8.18	9,252,489.11	52,877,193.72
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>27,209,422.78</b>	<b>76,185,524.67</b>
1. 管理人报酬		23,196,390.92	52,825,781.36

2. 托管费		3,866,065.16	8,804,297.04
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.8.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.8.20	146,966.70	14,555,446.27
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-718,367,393.92</b>	<b>-1,099,080,663.68</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-718,367,393.92</b>	<b>-1,099,080,663.68</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-718,367,393.92</b>	<b>-1,099,080,663.68</b>

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银国家安全灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末 净资产（基金 净值）	2,504,108,895. 91	-	1,562,052,442.8 5	4,066,161, 338.76
二、本期期初 净资产（基金 净值）	2,504,108,895.91	-	1,562,052,442.85	4,066,161,33 8.76
三、本期增减 变动额（减少 以“-”号填 列）	142,106,313.84	-	-985,852,288.00	- 843,745,974. 16
（一）、综合	-	-	-718,367,393.92	-

收益总额				718,367,393.92
(二)、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)	142,106,313.84	-	49,257,432.52	191,363,746.36
其中: 1.基金申购款	2,104,030,306.95	-	384,332,110.75	2,488,362,417.70
2.基金赎回款	-1,961,923,993.11	-	-335,074,678.23	-2,296,998,671.34
(三)、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)	-	-	-316,742,326.60	-316,742,326.60
四、本期期末净资产(基金净值)	2,646,215,209.75	-	576,200,154.85	3,222,415,364.60
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	2,755,147,468.40	-	897,091,774.52	3,652,239,242.92
二、本期期初净资产(基金净值)	2,755,147,468.40	-	897,091,774.52	3,652,239,242.92
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,417,887,037.69	-	372,349,560.93	4,790,236,598.62
(一)、综合收益总额	-	-	-1,099,080,663.68	-1,099,080,663.68
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净	4,417,887,037.69	-	1,471,430,224.61	5,889,317,262.30

值减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	12,654,730,006.18	-	2,957,535,460.74	15,612,265,466.92
2.基金赎回款	-8,236,842,968.49	-	-1,486,105,236.13	-9,722,948,204.62
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	7,173,034,506.09	-	1,269,441,335.45	8,442,475,841.54

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

国投瑞银国家安全灵活配置混合型证券投资基金（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]1983号文《关于准予国投瑞银国家安全灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人国投瑞银基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2015 年 12 月 2 日正式生效，首次设立募集规模为 694,113,991.09 份基金份额。

本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司，注册登记机构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（以下简称“中国银行”）

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、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）。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%；投资于本基金定义的国家安全主题相关的证券资产不低于基金非现金资产的 80%；投资于权证的比例不超过基金资产的 3%；每个交易日日终在扣除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。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。

本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.5.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债

（或资产）或权益工具的合同。

#### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### （2）金融负债分类

除了由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

### 6.4.5.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率

计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### **6.4.5.3 收入/(损失)的确认和计量**

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关

交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入企业；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 6.4.6 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.6.1 会计政策变更的说明

###### 新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初留存收益。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金

融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日，原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 229,703,735.33 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 21,977.67 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 229,725,713.00 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,908,743.50 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,658.90 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,911,402.40 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,679,503.99 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,205.80 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,680,709.79 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 367,899.35 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 21,977.67 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 2,658.90 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 1,205.80 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 342,056.98 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 20,401,308.22 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 342,056.98 元，重新计量预

期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 20,743,365.20 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产及金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.6.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.6.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.7 税项

##### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

##### (2) 增值税及附加、企业所得税

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

证券投资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，股权的股息、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）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 6.4.8 重要财务报表项目的说明

### 6.4.8.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	178,990,816.63
等于：本金	178,975,342.93
加：应计利息	15,473.70
定期存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	178,990,816.63

#### 6.4.8.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,086,699,120.23	-	3,039,365,663.83	-47,333,456.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	69,706.56	3,065,699.56	-3,591.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	69,706.56	3,065,699.56	-3,591.60
	资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,089,698,704.83	69,706.56	3,042,431,363.39	-47,337,048.00

#### 6.4.8.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.8.4 买入返售金融资产

##### 6.4.8.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.8.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.8.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	417,357.03
待摊费用	-
合计	417,357.03

#### 6.4.8.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	70,163.55
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,729,432.55
其中：交易所市场	3,729,432.55
银行间市场	-
应付利息	-
信息披露费	59,507.37
审计费用	54,547.97
合计	3,913,651.44

#### 6.4.8.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,504,108,895.91	2,504,108,895.91
本期申购	2,104,030,306.95	2,104,030,306.95
本期赎回（以“-”号填列）	-1,961,923,993.11	-1,961,923,993.11
本期末	2,646,215,209.75	2,646,215,209.75

注：本期申购包含基金转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

#### 6.4.8.8 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	645,993,970.10	916,058,472.75	1,562,052,442.85
本期利润	-298,810,053.03	-419,557,340.89	-718,367,393.92
本期基金份额交易产生的变动数	23,293,218.89	25,964,213.63	49,257,432.52
其中：基金申购款	202,072,832.10	182,259,278.65	384,332,110.75

基金赎回款	-178,779,613.21	-156,295,065.02	-335,074,678.23
本期已分配利润	-316,742,326.60	-	-316,742,326.60
本期末	53,734,809.36	522,465,345.49	576,200,154.85

#### 6.4.8.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	312,423.33
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	36,286.07
其他	90,287.17
合计	438,996.57

#### 6.4.8.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,221,523,967.47
减：卖出股票成本总额	3,501,905,041.03
减：交易费用	9,698,426.04
买卖股票差价收入	-290,079,499.60

#### 6.4.8.11 基金投资收益

无。

#### 6.4.8.12 债券投资收益

##### 6.4.8.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	12,122.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-3.06
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	12,119.82

##### 6.4.8.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	3.06
买卖债券差价收入	-3.06

#### 6.4.8.13 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.8.14 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.8.15 衍生工具收益

##### 6.4.8.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.8.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.8.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,775,263.85
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,775,263.85

#### 6.4.8.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-419,557,340.89
——股票投资	-419,553,749.29
——债券投资	-3,591.60
——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	-419,557,340.89

#### 6.4.8.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	9,075,451.48
基金转换费收入	177,037.63
合计	9,252,489.11

#### 6.4.8.19 信用减值损失

无。

#### 6.4.8.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	54,547.97
信息披露费	59,507.37
银行间账户维护费	9,000.00
汇划费	23,911.36
合计	146,966.70

#### 6.4.9 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.9.1 或有事项

无。

##### 6.4.9.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.10 关联方关系

##### 6.4.10.1 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。

##### 6.4.10.2 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、注册登记机构、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、基金销售机构
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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.11 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.11.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.11.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	253,991,598.28	4.03%	526,663,994.47	4.66%

#### 6.4.11.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	236,548.06	4.03%	205,379.39	5.51%
关联方名称	上年度可比期间 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	490,482.76	4.66%	112,107.75	3.67%

注：1、上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示，其中债券、回购及权证交易不计佣金。

2、该类席位租用协议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。

### 6.4.11.2 关联方报酬

#### 6.4.11.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
----	--	---

当期发生的基金应支付的管理费	23,196,390.92	52,825,781.36
其中：支付销售机构的客户维护费	8,325,302.69	19,112,078.00

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

#### 6.4.11.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,866,065.16	8,804,297.04

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.11.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.11.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 6.4.11.4.2 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

无。

#### 6.4.11.5 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	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		2021 年 1 月 1 日至 2021 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	178,990,816	312,423.33	465,814,16	760,373.14

	.63		0.46	
--	-----	--	------	--

**6.4.11.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.11.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.12 利润分配情况**

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份 额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配 合计	备注
		场 内	场 外					
1	2022-01-14	-	2022-01-14	1.290	225,739,217.40	91,003,109.20	316,742,326.60	-
合计				1.290	225,739,217.40	91,003,109.20	316,742,326.60	-

**6.4.13 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.13.1 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

6.4.13.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
300834	星辉环材	2022-01-06	6 个月	新股流通受限	55.57	30.03	635.00	35,286.95	19,069.05	-
301097	天益医疗	2022-03-25	6 个月	新股流通受限	52.37	47.83	249.00	13,040.13	11,909.67	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6 个月	新股流通受限	42.50	32.02	507.00	16,575.00	16,234.14	-
301111	青木	2022-	6 个	新股	63.1	39.85	202.00	12,74	8,049.	-

0	股份	03-04	月	流通受限	0			6.20	70	
301116	益客食品	2022-01-10	6个月	新股流通受限	11.40	20.46	577.00	6,577.80	11,805.42	-
301120	新特电气	2022-04-11	6个月	新股流通受限	13.73	15.49	1,032.00	14,169.36	15,985.68	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月	新股流通受限	37.23	25.39	656.00	24,422.88	16,655.84	-
301125	腾亚精工	2022-05-27	6个月	新股流通受限	22.49	27.42	327.00	7,354.23	8,966.34	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6个月	新股流通受限	31.98	26.26	338.00	10,809.24	8,875.88	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	6个月	新股流通受限	15.37	15.99	644.00	9,898.28	10,297.56	-
301150	中一科技	2022-04-14	6个月	新股流通受限	163.56	82.76	404.00	43,997.64	33,435.04	-
301151	冠龙节能	2022-03-30	6个月	新股流通受限	30.82	21.46	703.00	21,666.46	15,086.38	-
301153	中科江南	2022-05-10	6个月	新股流通受限	33.68	43.98	398.00	13,404.64	17,504.04	-
301158	德石股份	2022-01-07	6个月	新股流通受限	15.64	20.38	379.00	5,927.56	7,724.02	-
301160	翔楼新材	2022-05-25	6个月	新股流通受限	31.56	37.66	392.00	12,371.52	14,762.72	-
301162	国能日新	2022-04-19	6个月	新股流通受限	45.13	54.11	334.00	15,073.42	18,072.74	-
301181	标榜股份	2022-02-11	6个月	新股流通受限	40.25	30.59	257.00	10,344.25	7,861.63	-
301187	欧圣电气	2022-04-13	6个月	新股流通受限	21.33	22.54	876.00	18,685.08	19,745.04	-

301196	唯科科技	2022-01-04	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	271.00	17,365.68	10,167.92	-
301200	大族数控	2022-02-18	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	857.00	65,611.92	44,495.44	-
301201	诚达药业	2022-01-12	6个月	新股流通受限	72.69	71.54	353.00	25,659.57	25,253.62	-
301206	三元生物	2022-01-26	6个月	新股流通受限	109.30	45.69	945.00	68,859.00	43,177.05	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	569.00	32,364.72	32,102.98	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6个月	新股流通受限	29.67	33.28	416.00	12,342.72	13,844.48	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6个月	新股流通受限	3.80	6.39	4,743.00	18,023.40	30,307.77	-
301216	万凯新材	2022-03-21	6个月	新股流通受限	35.68	29.84	1,120.00	39,961.60	33,420.80	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6个月	新股流通受限	17.27	14.83	4,284.00	73,984.68	63,531.72	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月	新股流通受限	173.98	87.82	578.00	55,847.58	50,759.96	-
301220	亚香股份	2022-06-15	6个月	新股流通受限	35.98	39.15	285.00	10,254.30	11,157.75	-
301222	浙江恒威	2022-03-02	6个月	新股流通受限	33.98	28.96	332.00	11,281.36	9,614.72	-
301235	华康医疗	2022-01-21	6个月	新股流通受限	39.30	37.93	418.00	16,427.40	15,854.74	-
301236	软通动力	2022-03-08	6个月	新股流通受限	72.88	31.38	2,076.00	100,865.92	65,144.88	-
301237	和顺科技	2022-03-16	6个月	新股流通	56.69	41.86	261.00	14,796.09	10,925.46	-

				受限							
301238	瑞泰新材	2022-06-10	6个月	新股流通受限	19.18	32.07	3,497.00	67,072.46	112,148.79	-	
301248	杰创智能	2022-04-13	6个月	新股流通受限	39.07	29.87	472.00	18,441.04	14,098.64	-	
301256	华融化学	2022-03-14	6个月	新股流通受限	8.05	10.08	1,831.00	14,739.55	18,456.48	-	
301258	富士莱	2022-03-21	6个月	新股流通受限	48.30	41.68	295.00	14,248.50	12,295.60	-	
301266	宇邦新材	2022-05-30	6个月	新股流通受限	26.86	47.07	517.00	13,886.62	24,335.19	-	
301268	铭利达	2022-03-29	6个月	新股流通受限	28.50	34.87	641.00	18,268.50	22,351.67	-	
301279	金道科技	2022-04-06	6个月	新股流通受限	31.20	22.81	296.00	9,235.20	6,751.76	-	
301286	侨源股份	2022-06-06	6个月	新股流通受限	16.91	19.79	784.00	13,257.44	15,515.36	-	
301288	清研环境	2022-04-14	6个月	新股流通受限	19.09	19.98	452.00	8,628.68	9,030.96	-	
301298	东利机械	2022-05-27	6个月	新股流通受限	12.68	20.83	634.00	8,039.12	13,206.22	-	
301302	华如科技	2022-06-16	6个月	新股流通受限	52.03	56.42	466.00	24,245.98	26,291.72	-	
600938	中国海油	2022-04-14	6个月	新股流通受限	10.80	15.86	84,004.00	907,243.20	1,332,303.44	-	
688176	亚虹医药	2021-12-29	6个月	新股流通受限	22.98	12.53	37,990.00	873,010.20	476,014.70	-	
688279	峰昭科技	2022-04-13	6个月	新股流通受限	82.00	67.34	5,505.00	451,410.00	370,706.70	-	
30113	元道	2022-	1个	新股	38.4	38.46	5,651.	217,3	217,3	-	

9	通信	06-30	月内	未上市	6		00	37.46	37.46	
301175	中科环保	2022-06-30	1个月内	新股未上市	3.82	3.82	63,694.00	243,311.08	243,311.08	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	1个月内	新股未上市	41.52	41.52	1,576.00	65,435.52	65,435.52	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	1个月内	新股未上市	33.65	33.65	5,747.00	193,386.55	193,386.55	-
688237	超卓航科	2022-06-24	1个月内	新股未上市	41.27	41.27	2,891.00	119,311.57	119,311.57	-
688322	奥比中光	2022-06-30	1个月内	新股未上市	30.99	30.99	8,529.00	264,313.71	264,313.71	-
688400	凌云光	2022-06-27	1个月内	新股未上市	21.93	21.93	13,111.00	287,524.23	287,524.23	-

#### 6.4.13.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.13.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.13.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.13.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.14 金融工具风险及管理

##### 6.4.14.1 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，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、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、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规定）。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。

#### 6.4.14.2 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。

本公司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基金管理人制定的银行可投资名单内的已进行充分内部研究的信用等级较高的商业银行，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与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，因此违约风险发生的可能性很小；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。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2021 年 12 月 31 日：同）。

##### 6.4.14.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.14.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.14.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 6.4.14.2.4 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 2022 年 6 月 30 日	上年末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	3,065,699.56	-
合计	3,065,699.56	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分一般为国债、政策性金融债、短期融资券、超短期融资券和中期票据。

#### 6.4.14.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.14.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.14.3 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。

#### 6.4.14.3.1 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。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节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。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节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。

#### 6.4.14.4 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。

##### 6.4.14.4.1 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，控制证券投资基金组合的久期，防范利率风险。

##### 6.4.14.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	178,975,342.93	-	-	15,473.70	178,990,816.63
结算备付金	6,353,312.17	-	-	2,573.18	6,355,885.35
存出保证金	890,466.91	-	-	360.63	890,827.54
交易性金融资产	2,995,993.00	-	-	3,039,435,370.39	3,042,431,363.39
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	14,982,061.41	14,982,061.41
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	32,095,487.56	32,095,487.56
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	417,357.03	417,357.03
资产总计	189,215,115.01	-	-	3,086,948,683.90	3,276,163,798.91
负债					

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	6,211,997.29	6,211,997.29
应付赎回款	-	-	-	39,166,006.88	39,166,006.88
应付管理人报酬	-	-	-	3,820,096.02	3,820,096.02
应付托管费	-	-	-	636,682.68	636,682.68
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,913,651.44	3,913,651.44
负债总计	-	-	-	53,748,434.31	53,748,434.31
利率敏感度缺口	189,215,115.01	-	-	3,033,200,249.59	3,222,415,364.60
<b>上年度末</b>					
<b>2021 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	229,703,735.33	-	-	-	229,703,735.33
结算备付金	5,908,743.50	-	-	-	5,908,743.50
存出保证金	2,679,503.99	-	-	-	2,679,503.99
交易性金融资产	-	-	-	3,848,205,814.05	3,848,205,814.05
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	85,902,902.45	85,902,902.45
应收利息	-	-	-	367,899.35	367,899.35
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	20,401,308.22	20,401,308.22
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	238,291,982.82	-	-	3,954,877,924.07	4,193,169,906.89
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	-	-	-	114,287,664.79	114,287,664.79
应付管理人报酬	-	-	-	5,137,443.46	5,137,443.46
应付托管费	-	-	-	856,240.60	856,240.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	6,277,833.64	6,277,833.64
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	449,385.64	449,385.64
负债总计	-	-	-	127,008,568.13	127,008,568.13
利率敏感度缺口	238,291,982.82	-	-	3,827,869,355.94	4,066,161,338.76

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。

#### 6.4.14.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 06 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 0.10%（2021 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2021 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.14.4.2 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。

#### 6.4.14.4.3 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。

#### 6.4.14.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	3,039,365,663.8 3	94.32	3,848,205,814.0 5	94.64
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,065,699.56	0.10	-	-
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	3,042,431,363.3 9	94.41	3,848,205,814.0 5	94.64

#### 6.4.14.3.2 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
----	---

	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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	基金业绩比较基准增加 5%	245,694,364.55	273,360,484.08
	基金业绩比较基准减少 5%	-245,694,364.55	-273,360,484.08

注：基金业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。

## 6.4.15 公允价值

### 6.4.15.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.15.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.15.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	3,034,799,736.30	3,845,236,415.95
第二层次	4,456,319.68	2,969,398.10
第三层次	3,175,307.41	-
合计	3,042,431,363.39	3,848,205,814.05

#### 6.4.15.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

## 6.4.16 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	3,039,365,663.83	92.77
	其中：股票	3,039,365,663.83	92.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,065,699.56	0.09
	其中：债券	3,065,699.56	0.09
	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	185,346,701.98	5.66
8	其他各项资产	48,385,733.54	1.48
9	合计	3,276,163,798.91	100.00

注：1、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、本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”，“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额，下同。

### 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	1,332,303.44	0.04
C	制造业	2,988,464,506.81	92.74

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	84,998.04	0.00
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	48,944,519.21	1.52
J	金融业	-	-
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	67,650.51	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	262,065.13	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,620.69	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,039,365,663.83	94.32

### 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	600760	中航沈飞	5,277,278.00	319,011,455.10	9.90
2	000768	中航西飞	10,422,202.00	315,688,498.58	9.80
3	600372	中航电子	15,973,413.00	309,724,478.07	9.61
4	600316	洪都航空	8,793,937.00	265,928,654.88	8.25

5	000738	航发控制	9,302,987.00	261,413,934.70	8.11
6	300777	中简科技	4,809,814.00	231,833,034.80	7.19
7	600391	航发科技	11,302,637.00	217,123,656.77	6.74
8	600862	中航高科	7,267,739.00	204,223,465.90	6.34
9	002013	中航机电	10,763,278.00	132,926,483.30	4.13
10	600038	中直股份	2,907,300.00	131,409,960.00	4.08
11	600456	宝钛股份	1,858,315.00	110,383,911.00	3.43
12	688239	航宇科技	1,932,536.00	103,004,168.80	3.20
13	300114	中航电测	4,390,524.00	51,281,320.32	1.59
14	688568	中科星图	707,208.00	47,920,414.08	1.49
15	002179	中航光电	714,827.00	45,262,845.64	1.40
16	300855	图南股份	1,022,488.00	42,729,773.52	1.33
17	688586	江航装备	1,421,833.00	37,834,976.13	1.17
18	002935	天奥电子	1,489,730.00	33,980,741.30	1.05
19	600967	内蒙一机	2,967,165.00	27,060,544.80	0.84
20	002625	光启技术	1,552,600.00	26,813,402.00	0.83
21	605123	派克新材	188,910.00	26,583,415.20	0.82
22	003031	中瓷电子	335,332.00	21,662,447.20	0.67
23	300516	久之洋	595,700.00	16,292,395.00	0.51
24	002025	航天电器	210,000.00	14,662,200.00	0.46
25	600765	中航重机	308,735.00	9,935,092.30	0.31
26	600893	航发动力	214,913.00	9,780,690.63	0.30
27	600416	湘电股份	335,840.00	6,367,526.40	0.20
28	688510	航亚科技	272,068.00	5,212,822.88	0.16
29	688122	西部超导	32,928.00	3,035,961.60	0.09
30	603267	鸿远电子	10,000.00	1,343,300.00	0.04
31	600938	中国海油	84,004.00	1,332,303.44	0.04
32	600150	中国船舶	54,400.00	1,032,512.00	0.03
33	688047	龙芯中科	8,345.00	768,991.75	0.02
34	300775	三角防务	15,600.00	751,140.00	0.02
35	688176	亚虹医药	37,990.00	476,014.70	0.01
36	603678	火炬电子	10,075.00	471,610.75	0.01
37	600990	四创电子	10,000.00	413,500.00	0.01
38	688279	峰岬科技	5,505.00	370,706.70	0.01
39	688400	凌云光	13,111.00	287,524.23	0.01
40	301302	华如科技	4,651.00	282,999.62	0.01
41	688322	奥比中光	8,529.00	264,313.71	0.01
42	301175	中科环保	63,694.00	243,311.08	0.01
43	301139	元道通信	5,651.00	217,337.46	0.01
44	301239	普瑞眼科	5,747.00	193,386.55	0.01
45	600562	国睿科技	10,000.00	148,500.00	0.00
46	688237	超卓航科	2,891.00	119,311.57	0.00
47	301238	瑞泰新材	3,497.00	112,148.79	0.00

48	301155	海力风电	1,054.00	95,914.00	0.00
49	301233	盛帮股份	1,576.00	65,435.52	0.00
50	301236	软通动力	2,076.00	65,144.88	0.00
51	301217	铜冠铜箔	4,284.00	63,531.72	0.00
52	301177	迪阿股份	792.00	58,766.40	0.00
53	001270	铖昌科技	568.00	57,481.60	0.00
54	301219	腾远钴业	578.00	50,759.96	0.00
55	301200	大族数控	857.00	44,495.44	0.00
56	301206	三元生物	945.00	43,177.05	0.00
57	601089	福元医药	1,749.00	36,816.45	0.00
58	301150	中一科技	404.00	33,435.04	0.00
59	301216	万凯新材	1,120.00	33,420.80	0.00
60	301207	华兰疫苗	569.00	32,102.98	0.00
61	301215	中汽股份	4,743.00	30,307.77	0.00
62	001323	慕思股份	573.00	28,111.38	0.00
63	301201	诚达药业	353.00	25,253.62	0.00
64	301266	宇邦新材	517.00	24,335.19	0.00
65	301268	铭利达	641.00	22,351.67	0.00
66	301096	百诚医药	272.00	21,488.00	0.00
67	301211	亨迪药业	967.00	20,964.56	0.00
68	301187	欧圣电气	876.00	19,745.04	0.00
69	300834	星辉环材	635.00	19,069.05	0.00
70	301101	明月镜片	371.00	19,043.43	0.00
71	301127	天源环保	1,685.00	18,754.05	0.00
72	301256	华融化学	1,831.00	18,456.48	0.00
73	301221	光庭信息	280.00	18,152.40	0.00
74	301162	国能日新	334.00	18,072.74	0.00
75	301153	中科江南	398.00	17,504.04	0.00
76	301123	奕东电子	656.00	16,655.84	0.00
77	301103	何氏眼科	507.00	16,234.14	0.00
78	301120	新特电气	1,032.00	15,985.68	0.00
79	301235	华康医疗	418.00	15,854.74	0.00
80	301286	侨源股份	784.00	15,515.36	0.00
81	301151	冠龙节能	703.00	15,086.38	0.00
82	301166	优宁维	253.00	14,891.58	0.00
83	301168	通灵股份	329.00	14,831.32	0.00
84	301160	翔楼新材	392.00	14,762.72	0.00
85	301189	奥尼电子	435.00	14,489.85	0.00
86	301248	杰创智能	472.00	14,098.64	0.00
87	301212	联盛化学	416.00	13,844.48	0.00
88	301190	善水科技	575.00	13,644.75	0.00
89	301298	东利机械	634.00	13,206.22	0.00
90	301100	风光股份	599.00	12,926.42	0.00

91	301258	富士莱	295.00	12,295.60	0.00
92	301179	泽宇智能	295.00	12,038.95	0.00
93	301097	天益医疗	249.00	11,909.67	0.00
94	301116	益客食品	577.00	11,805.42	0.00
95	301126	达嘉维康	662.00	11,340.06	0.00
96	001268	联合精密	409.00	11,337.48	0.00
97	301220	亚香股份	285.00	11,157.75	0.00
98	301108	洁雅股份	280.00	11,079.60	0.00
99	301237	和顺科技	261.00	10,925.46	0.00
100	301111	粤万年青	379.00	10,392.18	0.00
101	301137	哈焊华通	644.00	10,297.56	0.00
102	301196	唯科科技	271.00	10,167.92	0.00
103	301222	浙江恒威	332.00	9,614.72	0.00
104	301288	清研环境	452.00	9,030.96	0.00
105	301125	腾亚精工	327.00	8,966.34	0.00
106	301135	瑞德智能	338.00	8,875.88	0.00
107	301193	家联科技	297.00	8,063.55	0.00
108	301110	青木股份	202.00	8,049.70	0.00
109	301181	标榜股份	257.00	7,861.63	0.00
110	301158	德石股份	379.00	7,724.02	0.00
111	301198	喜悦智行	341.00	7,689.55	0.00
112	301182	凯旺科技	294.00	6,985.44	0.00
113	301279	金道科技	296.00	6,751.76	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	600862	中航高科	303,778,771.37	7.47
2	000768	中航西飞	282,508,291.51	6.95
3	002179	中航光电	281,155,247.57	6.91
4	300777	中简科技	257,285,860.50	6.33
5	600765	中航重机	219,522,985.97	5.40
6	600038	中直股份	176,955,623.53	4.35
7	002013	中航机电	163,472,405.93	4.02
8	688239	航宇科技	157,456,837.92	3.87
9	600372	中航电子	144,447,014.16	3.55
10	600760	中航沈飞	129,125,387.41	3.18
11	600456	宝钛股份	107,432,072.48	2.64

12	600391	航发科技	95,036,454.12	2.34
13	002025	航天电器	89,438,753.85	2.20
14	600150	中国船舶	65,531,000.90	1.61
15	600893	航发动力	60,670,488.00	1.49
16	003031	中瓷电子	56,421,193.80	1.39
17	688586	江航装备	54,574,888.21	1.34
18	300855	图南股份	49,520,930.17	1.22
19	605123	派克新材	48,976,776.05	1.20
20	300114	中航电测	43,913,303.40	1.08

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	600038	中直股份	335,347,852.20	8.25
2	600967	内蒙一机	278,552,211.82	6.85
3	002179	中航光电	259,105,911.17	6.37
4	600862	中航高科	241,465,719.68	5.94
5	600765	中航重机	239,984,315.23	5.90
6	600416	湘电股份	211,648,204.78	5.21
7	600893	航发动力	191,400,270.14	4.71
8	600372	中航电子	177,221,286.38	4.36
9	600760	中航沈飞	164,762,387.59	4.05
10	300114	中航电测	137,561,806.56	3.38
11	300777	中简科技	87,076,822.51	2.14
12	000738	航发控制	81,954,965.40	2.02
13	688122	西部超导	77,569,084.00	1.91
14	000768	中航西飞	76,498,966.04	1.88
15	002025	航天电器	73,910,009.00	1.82
16	600150	中国船舶	55,015,569.82	1.35
17	600391	航发科技	52,289,368.00	1.29
18	688239	航宇科技	47,959,647.57	1.18
19	300855	图南股份	43,696,513.48	1.07
20	003031	中瓷电子	37,381,201.40	0.92

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	3,112,618,640.10
卖出股票的收入（成交）总额	3,221,523,967.47

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	3,065,699.56	0.10
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,065,699.56	0.10

### 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	019641	20 国债 11	29,930	3,065,699.56	0.10

### 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 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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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	890,827.54
2	应收清算款	14,982,061.41
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	32,095,487.56
6	其他应收款	417,357.03
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	48,385,733.54
---	----	---------------

#### 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中不存在流通受限股票。

#### 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
433,112	6,109.77	420,902,854.56	15.91%	2,225,312,355.19	84.09%

### 8.2 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	2,065,575.33	0.08%

### 8.3 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、基金投资和研究部门负责人持有	0~10

本开放式基金	
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 12 月 2 日）基金份额总额	694,113,991.09
本报告期期初基金份额总额	2,504,108,895.91
本报告期基金总申购份额	2,104,030,306.95
减：本报告期基金总赎回份额	1,961,923,993.11
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,646,215,209.75

## 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 2022 年 3 月 14 日起，王书鹏先生不再担任公司副总经理。
- 2、自 2022 年 4 月 28 日起，汪斌先生担任公司副总经理兼财务负责人。

### 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安永华明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	
东方证券	3	964,766,112.21	15.30%	898,490.51	15.30%	-
兴业证券	1	844,948,701.17	13.40%	786,918.23	13.40%	-
天风证券	1	650,536,523.00	10.32%	605,847.75	10.32%	-
中信证券	2	532,910,900.65	8.45%	496,293.93	8.45%	-
东北证券	2	529,551,471.81	8.40%	493,171.65	8.40%	-
信达证券	1	439,762,951.55	6.97%	409,557.73	6.97%	-
中信建投证券	2	405,980,009.11	6.44%	378,087.98	6.44%	-
华西证券	2	266,003,122.66	4.22%	247,733.83	4.22%	-
安信证券	1	253,991,598.28	4.03%	236,548.06	4.03%	-
申万宏源证券	1	252,953,692.72	4.01%	235,576.06	4.01%	-
开源证券	1	235,132,428.76	3.73%	218,972.10	3.73%	-
东方财富	1	227,521,668.51	3.61%	211,891.66	3.61%	-
中金公司	1	218,434,763.19	3.46%	203,430.83	3.46%	-
东亚前海	1	155,771,121.54	2.47%	145,068.81	2.47%	-
广发证券	1	113,918,898.80	1.81%	106,093.29	1.81%	-
太平洋证券	1	68,382,554.24	1.08%	63,684.65	1.08%	-
中泰证券	3	55,383,516.55	0.88%	51,578.98	0.88%	-
东兴证券	1	52,483,923.43	0.83%	48,879.63	0.83%	-
长江证券	1	32,020,138.04	0.51%	29,820.87	0.51%	-
国信证券	1	4,999,761.00	0.08%	4,656.46	0.08%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
野村东方	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-

华泰证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中信华南证券	1	-	-	-	-	-

### 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
开源证券	2,999,584.60	100.00%	-	-	-	-

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、本基金本报告期租用证券公司交易单元未发生变更。

### 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发布了关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告。	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	2022-01-01
2	报告期内基金管理人对本基金分红进行公告。	证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-12

3	报告期内基金管理人发布了高级管理人员变更的公告。	证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-15
4	报告期内基金管理人发布了关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告。	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	2022-04-15
5	报告期内基金管理人发布了高级管理人员变更的公告。	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-30

## 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

《关于准予国投瑞银国家安全灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》证监许可[2015]1983号

《关于国投瑞银国家安全灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》（机构部部函[2015] 3081号）

《国投瑞银国家安全灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

《国投瑞银国家安全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

### 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、0755-83160000

国投瑞银基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日