

国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金

2020 年中期报告

2020 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月二十八日

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介	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.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	13
6 中期财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47

7.12 投资组合报告附注.....	47
8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
9 开放式基金份额变动.....	51
10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
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.....	54
12 备查文件目录.....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金		
基金简称	国投瑞银沪深 300 指数分级		
基金主代码	161207		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2009 年 10 月 14 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		
报告期末基金份额总额	65,599,300.29 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	2009 年 11 月 19 日		
下属分级基金的基金简称	国投瑞银瑞和 沪深 300 指数	国投瑞银瑞和 小康沪深 300 指数	国投瑞银瑞和 远见沪深 300 指数
下属分级基金的场内简称	瑞和 300	瑞和小康	瑞和远见
下属分级基金的交易代码	161207	150008	150009
报告期末下属分级基金的份额 总额	46,518,930.29 份	9,540,185.00 份	9,540,185.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理,实现对沪深 300 指数的有效跟踪,力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在 0.35% 以内,年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用指数复制投资策略,按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合,并根据基准指数成份股及其权重的变动进行相应地调整,以复制和跟踪基准指数。当预期指数成份股调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为时,或者因特殊情况(如股权分置改革等)导致基金无法有效复制和跟踪基准指数时,基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整,并可在条件允许的情况下,辅以金融衍生工具进行投资管理,以有效控制基金的跟踪误差。
业绩比较基准	$95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王明辉	郭明
	联系电话	400-880-6868	010-66105798
	电子邮箱	service@ubssdic.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-880-6868	95588
传真		0755-82904048	010-66105799
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55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55号
邮政编码		518035	100140
法定代表人		叶柏寿	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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（2020年1月1日至2020年6月30日）
本期已实现收益	27,247,086.18

本期利润	6,587,265.67
加权平均基金份额本期利润	0.0336
本期加权平均净值利润率	3.24%
本期基金份额净值增长率	5.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	29,537,546.29
期末可供分配基金份额利润	0.4503
期末基金资产净值	73,034,012.20
期末基金份额净值	1.113
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	63.16%

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（例如封闭式基金交易佣金、开放式基金申购赎回费或基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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%	0.93%	7.29%	0.85%	0.98%	0.08%
过去三个月	14.51%	0.88%	12.29%	0.85%	2.22%	0.03%
过去六个月	5.30%	1.46%	1.64%	1.45%	3.66%	0.01%
过去一年	21.15%	1.19%	8.51%	1.16%	12.64%	0.03%
过去三年	34.69%	1.18%	13.27%	1.19%	21.42%	-0.01%
自基金合同生效起至今	63.16%	1.41%	30.72%	1.39%	32.44%	0.02%

注：1、本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。
本基金是以沪深 300 指数为标的指数的被动式、指数型基金，对沪深 300 指数成份股的配置基准为 95%，故以此为业绩比较基准，能够准确地反映本基金的投资绩效。

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

国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金
 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
 (2009 年 10 月 14 日至 2020 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

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 2020 年 6 月底，在公募基金方面，公司共管理 66 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		
殷瑞飞	本基金基金经理，量化投资部副总经理	2013-09-26	-	12	中国籍，博士，具有基金从业资格。2008 年 3 月至 2011 年 6 月任汇添富基金管理公司风险管理分析师。2011 年 6 月加入国投瑞银基金管理有限公司。曾任国投瑞银新价值灵活配置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。现任国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金、国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金、国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金（LOF）、国投瑞银中证 500 指数量化增强型证券投资基金及国投瑞银沪深 300 指数量化增强型证券投资基金基金经理。
赵建	本基金基金经理，量化投资部总监助理	2019-10-29	-	16	中国籍，博士，具有基金从业资格。2003 年 8 月至 2010 年 6 月历任上海数君投资有限公司（原上海博弘投资有限公司）高级软件工程师、风控经理。2010 年 6 月加入国投瑞银基金管理有限公司。曾任国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理。现任国投瑞银瑞福深证

					100 指数证券投资基金 (LOF) (原国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金)、国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金 (LOF)、国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (原国投瑞银沪深 300 金融地产指数基金)、国投瑞银白银期货证券投资基金 (LOF)、国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金及国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注 1: 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。

注 2: 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况。

姓名	产品类型	产品数量 (只)	资产净值(元)	任职时间
赵建	公募基金	7.00	2,201,284,745.46	2013-09-26
	私募资产管理计划	1.00	207,403,052.63	2020-06-23
	其他组合	-	-	-
	合计	8.00	2,408,687,798.09	

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

2020 年上半年受到新冠疫情的影响，全球资本市场波动剧烈，经济活动在停摆了接近 2 个月后又开启了重启键，各项经济数据在大幅下滑后出现缓慢回升，各国央行都实行了宽松的货币政策。在宽松的货币政策和政府积极的财政政策之下，股票市场在经历恐慌下跌后表现良好，结构分化明显。

基金投资操作上，作为指数基金，投资操作以严格控制跟踪误差为主，研究应对成分股调整、成分股停牌替代等机会成本、同时密切关注基金日常申购、赎回带来的影响及市场出现的结构性机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.113 元，本报告期份额净值增长率为 5.30%，同期业绩比较基准收益率为 1.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

疫情对全球经济的影响会贯穿 2020 全年，在短期疫苗出台无望的背景下，全球范围内经济活动的重启和渐进式复苏是大概率事件，但是经济增长和居民消费重回疫情前的水平将会需要较长时间。随着疫情的趋势性缓和，全球央行在疫情爆发期快速短促的货币宽松也将有所调整，不过，宽松态势还会延续。经济重启的幅度加快会使得总供给的恢复超过总需求的改善，除非农产品因为极端因素带来系统性的短缺，通胀整体依然会维持低水平。

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

根据《基金合同》的约定，在瑞和小康份额、瑞和远见份额的存续期内，本基金（包括瑞和 300 份额、瑞和小康份额、瑞和远见份额）不进行收益分配。

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，本基金托管人在对国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金的管理人--国投瑞银基金管理有限公司在国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金的投资运作、基金资产

净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对国投瑞银基金管理有限公司编制和披露的国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	4,513,853.16	16,955,546.31
结算备付金		24,358.06	-
存出保证金		21,561.59	44,180.83
交易性金融资产	6.4.7.2	67,965,133.87	253,765,163.16
其中：股票投资		67,965,133.87	253,296,164.49
基金投资		-	-
债券投资		-	468,998.67
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		2,047,968.12	-
应收利息	6.4.7.5	4,303.30	3,527.56
应收股利		-	-
应收申购款		-	202,131.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		74,577,178.10	270,970,549.15

负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：		-	-
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		1,213,745.21	180,184.58
应付管理人报酬		85,502.04	221,841.91
应付托管费		18,810.44	48,805.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	131,899.26	63,628.52
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	93,208.95	180,494.83
负债合计		1,543,165.90	694,955.06
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	43,496,465.91	178,216,452.02
未分配利润	6.4.7.10	29,537,546.29	92,059,142.07
所有者权益合计		73,034,012.20	270,275,594.09
负债和所有者权益总计		74,577,178.10	270,970,549.15

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，国投瑞银瑞和沪深 300 指数份额净值 1.113 元，国投瑞银瑞和小康沪深 300 指数份额净值 1.165 元，国投瑞银瑞和远见沪深 300 指数份额净值 1.061 元；基金份额总额 65,599,300.29 份，其中国投瑞银瑞和沪深 300 指数份额 46,518,930.29 份，国投瑞银瑞和小康沪深 300 指数份额 9,540,185.00 份，国投瑞银瑞和远见沪深 300 指数份额 9,540,185.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		8,382,622.59	40,431,147.44
1.利息收入		49,457.17	44,624.27

其中：存款利息收入	6.4.7.11	49,280.55	44,336.18
债券利息收入		176.62	288.09
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）		28,809,379.27	5,694,905.16
其中：股票投资收益	6.4.7.12	27,753,643.85	3,861,135.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	117,258.48	48,647.71
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	938,476.94	1,785,122.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-20,659,820.51	34,645,297.89
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	183,606.66	46,320.12
减：二、费用		1,795,356.92	1,303,863.47
1. 管理人报酬		1,014,892.67	819,461.78
2. 托管费		223,276.40	180,281.60
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	467,341.19	195,616.89
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.06	0.07
7. 其他费用	6.4.7.19	89,846.60	108,503.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,587,265.67	39,127,283.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,587,265.67	39,127,283.97

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	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	178,216,452.02	92,059,142.07	270,275,594.09

(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,587,265.67	6,587,265.67
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)	-134,719,986.11	-69,108,861.45	-203,828,847.56
其中：1.基金申购款	16,420,467.57	5,605,747.18	22,026,214.75
2.基金赎回款	-151,140,453.68	-74,714,608.63	-225,855,062.31
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)	43,496,465.91	29,537,546.29	73,034,012.20
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	139,418,897.67	6,489,860.98	145,908,758.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	39,127,283.97	39,127,283.97
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)	57,559,350.74	16,962,644.82	74,521,995.56
其中：1.基金申购款	91,169,385.83	24,385,635.10	115,555,020.93
2.基金赎回款	-33,610,035.09	-7,422,990.28	-41,033,025.37
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)	196,978,248.41	62,579,789.77	259,558,038.18

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

国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金(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[2009]865 号《关于核准国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金募集的批复》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《国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,215,075,553.30 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 204 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》于 2009 年 10 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,215,923,206.99 份基金份额,其中认购资金利息折合 847,653.69 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的基金份额包括国投瑞银瑞和沪深 300 指数证券投资基金之基础份额(以下简称"瑞和沪深 300 指数份额")、国投瑞银瑞和沪深 300 指数证券投资基金之小康份额(以下简称"瑞和小康份额")及国投瑞银瑞和沪深 300 指数证券投资基金之远见份额(以下简称"瑞和远见份额")。本基金一份瑞和小康份额与一份瑞和远见份额构成一对份额组合,一对瑞和小康份额与瑞和远见份额的份额组合的净值之和将等于两份瑞和沪深 300 指数份额的净值。在任一运作周年内,如果瑞和沪深 300 指数份额的基金份额净值大于 1.000 元,则在每份瑞和小康份额与每份瑞和远见份额各自获得 1.000 元净值的基础上,本基金将以年阈值(10%)为基准,将瑞和沪深 300 指数份额的基金份额净值超出 1.000 元的部分划分成年阈值以内和年阈值以外的两个部分,与此相对应,对于每一对瑞和小康份额与瑞和远见份额的份额组合所包含的年阈值以内的部分,由一份瑞和小康份额与一份瑞和远见份额按 8:2 的比例分成;对于每一对瑞和小康份额与瑞和远见份额的份额组合所包含的年阈值以外的部分,由一份瑞和小康份额与一份瑞和远见份额按 2:8 的比例分成。在任一运作周年内,如果瑞和沪深 300 指数份额的基金份额净值小于或等于 1.000 元,则瑞和小康份额、瑞和远见份额的基金份额净值相等,且等于瑞和沪深 300 指数份额的基金份额净值。

在瑞和小康份额、瑞和远见份额存续期内的每一个运作周年的最后一个工作日，本基金的基金管理人将根据基金合同的规定对本基金所有份额进行基金份额折算，将本基金所有份额的基金份额净值调整为 1.000 元。其中，如果瑞和沪深 300 指数份额折算前的基金份额净值大于 1.000 元，基金份额折算后，基金份额持有人持有的瑞和沪深 300 指数份额的份额数按照折算比例相应增加，瑞和小康份额、瑞和远见份额各自的新增份额将全部折算成基金份额持有人持有的瑞和沪深 300 指数份额；如果瑞和沪深 300 指数份额折算前的基金份额净值小于或等于 1.000 元，基金份额折算后，基金份额持有人持有的瑞和沪深 300 指数份额、瑞和小康份额、瑞和远见份额各自的份额数按照折算比例相应缩减。

瑞和沪深 300 指数份额接受场外与场内申购和赎回，瑞和小康份额、瑞和远见份额只上市交易但不接受申购和赎回，并可与瑞和沪深 300 指数份额相互间进行配对转换。经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上[2009]150 号文核准，瑞和小康份额、瑞和远见份额于 2009 年 11 月 19 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资的标的指数为沪深 300 指数，股票投资占基金资产的比例为 85%-95%，原则上投资于沪深 300 指数成份股票、备选成份股票的资产占基金资产的比例不低于 80%；除股票以外的其他资产投资占基金资产的比例为 5%-15%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金通过被动的指数化投资管理，实现对沪深 300 指数的有效跟踪，力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会及中国证券投资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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期无需说明的会计差错更正。

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	4,513,853.16
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	4,513,853.16

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	55,207,815.61	67,965,133.87	12,757,318.26

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		55,207,815.61	67,965,133.87	12,757,318.26

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	406.60
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	9.81
应收债券利息	-
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	2.85
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	3,884.04
合计	4,303.30

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	131,899.26
银行间市场应付交易费用	-
合计	131,899.26

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,701.35
审计费用	29,835.26
预提信息披露费	59,672.34
合计	93,208.95

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	255,711,008.06	178,216,452.02
本期申购	23,333,868.03	16,420,467.57
本期赎回（以“-”号填列）	-213,445,575.80	-151,140,453.68
本期末	65,599,300.29	43,496,465.91

注：申购含配对转换入份额；赎回含配对转换出份额。

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	69,723,367.02	22,335,775.05	92,059,142.07
本期利润	27,247,086.18	-20,659,820.51	6,587,265.67
本期基金份额交易产生的变动数	-63,422,762.62	-5,686,098.83	-69,108,861.45
其中：基金申购款	4,860,755.21	744,991.97	5,605,747.18
基金赎回款	-68,283,517.83	-6,431,090.80	-74,714,608.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,547,690.58	-4,010,144.29	29,537,546.29

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	44,672.94
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	552.56
其他	4,055.05
合计	49,280.55

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	215,619,986.27
减：卖出股票成本总额	187,866,342.42
买卖股票差价收入	27,753,643.85

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	679,542.45
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	561,995.71
减：应收利息总额	288.26
买卖债券差价收入	117,258.48

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	938,476.94
基金投资产生的股利收益	-
合计	938,476.94

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	-20,659,820.51
——股票投资	-20,611,418.22
——债券投资	-48,402.29
——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	-20,659,820.51
----	----------------

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	183,606.66
合计	183,606.66

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	467,341.19
银行间市场交易费用	-
合计	467,341.19

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
资金汇划费	339.00
其他费用	-
合计	89,846.60

注：本基金标的指数使用费由基金管理人国投瑞银基金管理有限公司承担，不计入本基金费用。

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

1、基金管理人于 2020 年 8 月 27 日发布《关于国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金瑞和小康份额、瑞和远见份额已自 2020 年 8 月 26 日开市起停牌，并将不再复牌，基金管理人将依据深

圳证券交易所的业务规定申请本基金瑞和小康份额、瑞和远见份额终止上市。本基金将自 2020 年 8 月 28 日起进入清算程序。

2、截至本报告送出日，本基金无其他须作披露的资产负债表日后事项。

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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金销售机构
瑞银证券股份有限公司("瑞银证券")	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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
瑞银证券	37,701,602.12	16.01%	-	-

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 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
瑞银证券	35,112.27	16.01%	9,359.90	7.10%

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

管理费、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。

6.4.10.2 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 2020年1月1日至2020年 6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,014,892.67	819,461.78
其中：支付销售机构的客户维护费	103,967.30	87,629.09

注：支付基金管理人国投瑞银基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 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 × 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	223,276.40	180,281.60

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22% 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 × 0.22% / 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

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的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

本报告期本基金基金管理人未运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

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 2020年1月1日至2020年6月 30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
	中国工商银行	4,513,853.16	44,672.94	22,387,944.63

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 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须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2020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
688396	华润微	2020-02-14	2020-08-27	新股锁定	12.80	41.45	19,761.00	252,940.80	819,093.45
688100	威胜信息	2020-01-09	2020-07-21	新股锁定	13.78	25.92	11,602.00	159,875.56	300,723.84
688181	八亿时空	2019-12-27	2020-07-06	新股锁定	43.98	61.09	3,468.00	152,522.64	211,860.12
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	5.94	5.94	1,185.00	7,038.90	7,038.90

注：1. 基金可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

2. 基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》,本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的,锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

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的股票。

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

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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

本基金是一只被动型指数证券投资基金,投资的标的指数为沪深 300 指数,属于高风险、高收益的基金品种,其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金在日常经营活动中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。本基金的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。

本基金的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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。本基金在证券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；基金在银行间同业市场仅与达到本基金的基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，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，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2019 年 12 月 31 日：0.17%)。

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按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 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
AAA	-	461,798.72
AAA 以下	-	7,199.95
未评级	-	-
合计	-	468,998.67

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。

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规避利率风险，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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	4,513,853.16	-	-	-	4,513,853.16
结算备付金	24,358.06	-	-	-	24,358.06
存出保证金	21,561.59	-	-	-	21,561.59
交易性金融资产	-	-	-	67,965,133.87	67,965,133.87
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	2,047,968.12	2,047,968.12
应收利息	-	-	-	4,303.30	4,303.30
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,559,772.81	-	-	70,017,405.29	74,577,178.10
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	-	-	-	1,213,745.21	1,213,745.21
应付管理人报酬	-	-	-	85,502.04	85,502.04
应付托管费	-	-	-	18,810.44	18,810.44
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	131,899.26	131,899.26
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	93,208.95	93,208.95
负债总计	-	-	-	1,543,165.90	1,543,165.90
利率敏感度缺口	4,559,772.81	-	-	68,474,239.39	73,034,012.20
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,955,546.31	-	-	-	16,955,546.31
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	44,180.83	-	-	-	44,180.83
交易性金融资产	-	95,397.87	373,600.80	253,296,164.49	253,765,163.16
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	-	-	-	3,527.56	3,527.56
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	202,131.29	202,131.29
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,999,727.14	95,397.87	373,600.80	253,501,823.34	270,970,549.15
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	-	-	-	180,184.58	180,184.58
应付管理人报酬	-	-	-	221,841.91	221,841.91
应付托管费	-	-	-	48,805.22	48,805.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	63,628.52	63,628.52
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	180,494.83	180,494.83
负债总计	-	-	-	694,955.06	694,955.06
利率敏感度缺口	16,999,727.14	95,397.87	373,600.80	252,806,868.28	270,275,594.09

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

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，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股票和债券，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。

本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪基准指数。当预期指数成份股调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为时，或者因特殊情况导致基金无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整，以有效控制基金的跟踪误差。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例为 85%-95%；除股票以外的其他资产投资占基金资产的比例为 5%-15%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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，及时可靠地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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	67,965,133.87	93.06	253,296,164.49	93.72
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	-	-	468,998.67	0.17
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	67,965,133.87	93.06	253,765,163.16	93.89

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	3,676,162.62	13,153,761.80
	业绩比较基准下降 5%	-3,676,162.62	-13,153,761.80

注：本基金的业绩比较基准=95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。

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	67,965,133.87	91.13
	其中：股票	67,965,133.87	91.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	4,538,211.22	6.09
8	其他各项资产	2,073,833.01	2.78
9	合计	74,577,178.10	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 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	971,616.00	1.33
B	采矿业	1,627,302.42	2.23
C	制造业	32,177,108.80	44.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,231,001.57	1.69
E	建筑业	1,254,907.77	1.72
F	批发和零售业	771,348.57	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	1,791,383.64	2.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,741,927.57	3.75
J	金融业	17,611,728.23	24.11
K	房地产业	2,424,428.20	3.32
L	租赁和商务服务业	991,693.64	1.36
M	科学研究和技术服务业	630,991.20	0.86
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	105,450.00	0.14
Q	卫生和社会工作	794,123.31	1.09
R	文化、体育和娱乐业	261,991.60	0.36

S	综合	-	-
	合计	65,387,002.52	89.53

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,350,468.13	1.85
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	-	-
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	1,227,663.22	1.68
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	-	-
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	2,578,131.35	3.53

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资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	600519	贵州茅台	2,781.00	4,068,269.28	5.57
2	601318	中国平安	49,334.00	3,522,447.60	4.82
3	600036	招商银行	53,386.00	1,800,175.92	2.46
4	600276	恒瑞医药	17,584.00	1,623,003.20	2.22
5	000858	五粮液	8,802.00	1,506,198.24	2.06
6	000333	美的集团	21,920.00	1,310,596.80	1.79
7	000651	格力电器	22,481.00	1,271,750.17	1.74
8	002475	立讯精密	22,343.00	1,147,313.05	1.57
9	601166	兴业银行	68,917.00	1,087,510.26	1.49
10	000002	万科 A	37,893.00	990,523.02	1.36
11	300059	东方财富	46,652.00	942,370.40	1.29
12	600887	伊利股份	28,590.00	890,006.70	1.22
13	600030	中信证券	36,486.00	879,677.46	1.20
14	601012	隆基股份	20,657.00	841,359.61	1.15
15	000001	平安银行	60,434.00	773,555.20	1.06
16	601888	中国中免	4,888.00	752,898.64	1.03
17	601688	华泰证券	38,875.00	730,850.00	1.00
18	000661	长春高新	1,600.00	696,480.00	0.95
19	600048	保利地产	44,400.00	656,232.00	0.90
20	600031	三一重工	33,846.00	634,950.96	0.87
21	000063	中兴通讯	15,797.00	633,933.61	0.87
22	603259	药明康德	6,532.00	630,991.20	0.86
23	601939	建设银行	99,400.00	627,214.00	0.86
24	600309	万华化学	12,438.00	621,775.62	0.85
25	002142	宁波银行	23,083.00	606,390.41	0.83
26	600900	长江电力	30,546.00	578,541.24	0.79
27	002714	牧原股份	6,936.00	568,752.00	0.78
28	603986	兆易创新	2,260.00	533,156.60	0.73
29	600585	海螺水泥	9,913.00	524,496.83	0.72
30	600570	恒生电子	4,775.00	514,267.50	0.70
31	601288	农业银行	149,019.0 0	503,684.22	0.69
32	002415	海康威视	16,523.00	501,473.05	0.69
33	002241	歌尔股份	16,794.00	493,071.84	0.68
34	600837	海通证券	38,909.00	489,475.22	0.67

35	601328	交通银行	93,826.00	481,327.38	0.66
36	600745	闻泰科技	3,600.00	453,420.00	0.62
37	601601	中国太保	16,310.00	444,447.50	0.61
38	601668	中国建筑	92,079.00	439,216.83	0.60
39	600016	民生银行	76,380.00	433,074.60	0.59
40	000338	潍柴动力	30,620.00	420,106.40	0.58
41	600588	用友网络	9,366.00	413,040.60	0.57
42	300498	温氏股份	18,480.00	402,864.00	0.55
43	000725	京东方 A	83,797.00	391,331.99	0.54
44	000538	云南白药	3,966.00	372,050.46	0.51
45	600547	山东黄金	10,100.00	369,862.00	0.51
46	002120	韵达股份	15,019.00	367,214.55	0.50
47	600000	浦发银行	33,792.00	357,519.36	0.49
48	600009	上海机场	4,864.00	350,548.48	0.48
49	002311	海大集团	6,900.00	328,371.00	0.45
50	300347	泰格医药	3,200.00	326,016.00	0.45
51	603288	海天味业	2,606.00	324,186.40	0.44
52	000568	泸州老窖	3,536.00	322,200.32	0.44
53	300136	信维通信	5,466.00	289,807.32	0.40
54	601899	紫金矿业	65,527.00	288,318.80	0.39
55	002352	顺丰控股	5,200.00	284,440.00	0.39
56	002555	三七互娱	5,901.00	276,166.80	0.38
57	002271	东方雨虹	6,768.00	274,983.84	0.38
58	600436	片仔癀	1,600.00	272,400.00	0.37
59	300122	智飞生物	2,700.00	270,405.00	0.37
60	603501	韦尔股份	1,300.00	262,535.00	0.36
61	600809	山西汾酒	1,800.00	261,000.00	0.36
62	002594	比亚迪	3,547.00	254,674.60	0.35
63	002230	科大讯飞	6,779.00	253,737.97	0.35
64	002044	美年健康	17,496.00	252,117.36	0.35
65	601933	永辉超市	26,746.00	250,877.48	0.34
66	002602	世纪华通	15,921.00	243,750.51	0.33
67	600019	宝钢股份	53,036.00	241,844.16	0.33
68	600104	上汽集团	14,169.00	240,731.31	0.33
69	300433	蓝思科技	8,499.00	238,311.96	0.33
70	600893	航发动力	9,960.00	233,860.80	0.32
71	600690	海尔智家	13,145.00	232,666.50	0.32
72	000938	紫光股份	5,388.00	231,576.24	0.32
73	002236	大华股份	11,754.00	225,794.34	0.31
74	600011	华能国际	53,500.00	225,770.00	0.31
75	002027	分众传媒	40,400.00	225,028.00	0.31
76	002624	完美世界	3,900.00	224,796.00	0.31
77	601169	北京银行	45,777.00	224,307.30	0.31

78	600027	华电国际	65,500.00	224,010.00	0.31
79	000977	浪潮信息	5,700.00	223,326.00	0.31
80	601229	上海银行	26,636.00	221,078.80	0.30
81	300124	汇川技术	5,759.00	218,784.41	0.30
82	601186	中国铁建	26,089.00	218,625.82	0.30
83	601088	中国神华	15,162.00	217,726.32	0.30
84	300015	爱尔眼科	4,971.00	215,989.95	0.30
85	000100	TCL 科技	32,889.00	203,911.80	0.28
86	600438	通威股份	11,700.00	203,346.00	0.28
87	002460	赣锋锂业	3,775.00	202,226.75	0.28
88	002456	欧菲光	10,877.00	200,028.03	0.27
89	300142	沃森生物	3,800.00	198,968.00	0.27
90	000157	中联重科	30,183.00	194,076.69	0.27
91	300003	乐普医疗	5,300.00	193,556.00	0.27
92	600958	东方证券	20,300.00	192,647.00	0.26
93	600050	中国联通	39,008.00	188,798.72	0.26
94	601211	国泰君安	10,900.00	188,134.00	0.26
95	603799	华友钴业	4,840.00	188,082.40	0.26
96	601818	光大银行	51,864.00	185,673.12	0.25
97	002304	洋河股份	1,721.00	180,945.94	0.25
98	600196	复星医药	5,345.00	180,928.25	0.25
99	601390	中国中铁	35,501.00	178,215.02	0.24
100	601021	春秋航空	5,000.00	176,200.00	0.24
101	002001	新和成	6,000.00	174,600.00	0.24
102	002410	广联达	2,500.00	174,250.00	0.24
103	601988	中国银行	49,515.00	172,312.20	0.24
104	601607	上海医药	9,373.00	172,275.74	0.24
105	601117	中国化学	31,000.00	169,880.00	0.23
106	603019	中科曙光	4,400.00	168,960.00	0.23
107	600038	中直股份	4,099.00	168,345.93	0.23
108	601225	陕西煤业	23,200.00	167,272.00	0.23
109	000783	长江证券	24,797.00	167,131.78	0.23
110	601108	财通证券	16,000.00	164,000.00	0.22
111	300601	康泰生物	1,000.00	162,160.00	0.22
112	601766	中国中车	28,634.00	159,491.38	0.22
113	000776	广发证券	11,200.00	158,144.00	0.22
114	000876	新希望	5,200.00	154,960.00	0.21
115	600999	招商证券	6,971.00	153,013.45	0.21
116	600183	生益科技	5,200.00	152,204.00	0.21
117	600703	三安光电	5,978.00	149,450.00	0.20
118	600741	华域汽车	7,071.00	147,006.09	0.20
119	002007	华兰生物	2,926.00	146,621.86	0.20
120	300033	同花顺	1,100.00	146,388.00	0.20

121	601377	兴业证券	20,665.00	141,555.25	0.19
122	600998	九州通	7,600.00	141,512.00	0.19
123	603160	汇顶科技	600.00	133,740.00	0.18
124	600660	福耀玻璃	6,406.00	133,693.22	0.18
125	600028	中国石化	33,836.00	132,298.76	0.18
126	600346	恒力石化	9,323.00	130,522.00	0.18
127	300413	芒果超媒	1,980.00	129,096.00	0.18
128	603833	欧派家居	1,100.00	127,490.00	0.17
129	000656	金科股份	15,600.00	127,296.00	0.17
130	601066	中信建投	3,200.00	126,016.00	0.17
131	001979	招商蛇口	7,613.00	125,157.72	0.17
132	600919	江苏银行	22,000.00	124,740.00	0.17
133	601006	大秦铁路	17,115.00	120,489.60	0.16
134	000895	双汇发展	2,600.00	119,834.00	0.16
135	002371	北方华创	700.00	119,637.00	0.16
136	600406	国电南瑞	5,691.00	115,242.75	0.16
137	300014	亿纬锂能	2,400.00	114,840.00	0.16
138	002493	荣盛石化	9,100.00	111,930.00	0.15
139	601628	中国人寿	4,100.00	111,561.00	0.15
140	600867	通化东宝	6,400.00	111,552.00	0.15
141	002129	中环股份	4,800.00	107,808.00	0.15
142	000166	申万宏源	21,300.00	107,565.00	0.15
143	002607	中公教育	3,800.00	105,450.00	0.14
144	601336	新华保险	2,377.00	105,253.56	0.14
145	601009	南京银行	14,300.00	104,819.00	0.14
146	603993	洛阳钼业	27,020.00	99,163.40	0.14
147	002050	三花智控	4,421.00	96,819.90	0.13
148	601857	中国石油	22,949.00	96,156.31	0.13
149	000625	长安汽车	8,653.00	95,183.00	0.13
150	600015	华夏银行	14,794.00	90,539.28	0.12
151	002008	大族激光	2,415.00	86,819.25	0.12
152	601989	中国重工	21,531.00	86,124.00	0.12
153	600369	西南证券	18,160.00	83,354.40	0.11
154	601788	光大证券	5,100.00	81,906.00	0.11
155	600352	浙江龙盛	6,300.00	80,577.00	0.11
156	002916	深南电路	480.00	80,409.60	0.11
157	000860	顺鑫农业	1,400.00	79,772.00	0.11
158	002841	视源股份	800.00	79,616.00	0.11
159	601808	中海油服	6,000.00	78,840.00	0.11
160	002024	苏宁易购	8,975.00	78,710.75	0.11
161	601155	新城控股	2,500.00	78,100.00	0.11
162	600383	金地集团	5,561.00	76,185.70	0.10
163	002252	上海莱士	8,988.00	76,038.48	0.10

164	002463	沪电股份	3,000.00	74,940.00	0.10
165	300408	三环集团	2,700.00	74,790.00	0.10
166	601138	工业富联	4,900.00	74,235.00	0.10
167	601877	正泰电器	2,800.00	73,780.00	0.10
168	600968	海油发展	31,400.00	73,162.00	0.10
169	600340	华夏幸福	3,143.00	71,848.98	0.10
170	601901	方正证券	9,954.00	70,474.32	0.10
171	601800	中国交建	9,593.00	70,412.62	0.10
172	300144	宋城演艺	3,982.00	68,888.60	0.09
173	600522	中天科技	6,000.00	68,700.00	0.09
174	002736	国信证券	6,000.00	67,800.00	0.09
175	002202	金风科技	6,794.00	67,736.18	0.09
176	603369	今世缘	1,700.00	67,643.00	0.09
177	000425	徐工机械	11,306.00	66,818.46	0.09
178	601919	中远海控	19,200.00	66,624.00	0.09
179	600109	国金证券	5,825.00	66,463.25	0.09
180	002179	中航光电	1,600.00	65,616.00	0.09
181	603899	晨光文具	1,200.00	65,520.00	0.09
182	603658	安图生物	400.00	64,976.00	0.09
183	601100	恒立液压	800.00	64,160.00	0.09
184	000768	中航飞机	3,554.00	63,047.96	0.09
185	601669	中国电建	18,151.00	62,802.46	0.09
186	000963	华东医药	2,453.00	62,060.90	0.08
187	601555	东吴证券	7,511.00	61,289.76	0.08
188	600089	特变电工	8,947.00	60,571.19	0.08
189	601985	中国核电	14,800.00	60,532.00	0.08
190	000596	古井贡酒	400.00	60,096.00	0.08
191	000069	华侨城 A	9,900.00	59,994.00	0.08
192	002466	天齐锂业	2,543.00	58,361.85	0.08
193	000066	中国长城	4,400.00	58,080.00	0.08
194	600498	烽火通信	2,001.00	57,848.91	0.08
195	600010	宝钢股份	53,386.00	57,656.88	0.08
196	002422	科伦药业	2,700.00	56,700.00	0.08
197	600487	亨通光电	3,420.00	56,122.20	0.08
198	002157	正邦科技	3,200.00	55,936.00	0.08
199	300628	亿联网络	800.00	54,608.00	0.07
200	600118	中国卫星	1,765.00	54,414.95	0.07
201	600606	绿地控股	8,700.00	53,766.00	0.07
202	002146	荣盛发展	6,560.00	53,136.00	0.07
203	600029	南方航空	10,200.00	52,734.00	0.07
204	600332	白云山	1,617.00	52,277.61	0.07
205	600795	国电电力	27,865.00	51,550.25	0.07
206	600926	杭州银行	5,760.00	51,379.20	0.07

207	000786	北新建材	2,400.00	51,192.00	0.07
208	600705	中航资本	12,788.00	50,640.48	0.07
209	600111	北方稀土	5,358.00	49,936.56	0.07
210	600637	东方明珠	5,066.00	48,886.90	0.07
211	601162	天风证券	8,010.00	48,540.60	0.07
212	002601	龙蟠佰利	2,600.00	48,100.00	0.07
213	601111	中国国航	7,231.00	47,796.91	0.07
214	601360	三六零	2,600.00	47,606.00	0.07
215	600271	航天信息	2,930.00	47,583.20	0.07
216	600372	中航电子	3,522.00	46,913.04	0.06
217	002508	老板电器	1,501.00	46,696.11	0.06
218	600176	中国巨石	5,100.00	46,665.00	0.06
219	600233	圆通速递	3,200.00	46,592.00	0.06
220	600760	中航沈飞	1,400.00	45,948.00	0.06
221	600115	东方航空	10,740.00	45,322.80	0.06
222	002773	康弘药业	910.00	45,136.00	0.06
223	002938	鹏鼎控股	900.00	45,054.00	0.06
224	601727	上海电气	8,791.00	44,306.64	0.06
225	601816	京沪高铁	7,100.00	44,233.00	0.06
226	600085	同仁堂	1,600.00	43,392.00	0.06
227	601838	成都银行	5,400.00	42,984.00	0.06
228	601600	中国铝业	15,510.00	42,807.60	0.06
229	002153	石基信息	1,094.00	42,698.82	0.06
230	601618	中国中冶	17,000.00	42,670.00	0.06
231	002032	苏泊尔	600.00	42,600.00	0.06
232	600066	宇通客车	3,457.00	42,175.40	0.06
233	600489	中金黄金	4,539.00	41,486.46	0.06
234	000728	国元证券	4,935.00	41,454.00	0.06
235	003816	中国广核	14,000.00	41,440.00	0.06
236	600004	白云机场	2,700.00	41,148.00	0.06
237	600177	雅戈尔	6,869.00	40,939.24	0.06
238	601997	贵阳银行	5,680.00	40,668.80	0.06
239	000703	恒逸石化	4,440.00	40,537.20	0.06
240	600221	海航控股	26,977.00	40,465.50	0.06
241	600068	葛洲坝	6,767.00	40,263.65	0.06
242	000961	中南建设	4,500.00	40,050.00	0.05
243	601231	环旭电子	1,800.00	39,312.00	0.05
244	600390	五矿资本	5,560.00	39,253.60	0.05
245	601881	中国银河	3,400.00	38,998.00	0.05
246	601998	中信银行	7,537.00	38,815.55	0.05
247	601198	东兴证券	3,500.00	38,150.00	0.05
248	600848	上海临港	1,700.00	36,499.00	0.05
249	600362	江西铜业	2,678.00	36,045.88	0.05

250	002673	西部证券	4,400.00	35,904.00	0.05
251	600018	上港集团	8,538.00	35,859.60	0.05
252	600516	方大炭素	5,694.00	35,758.32	0.05
253	600398	海澜之家	6,100.00	35,502.00	0.05
254	002739	万达电影	2,300.00	35,121.00	0.05
255	601878	浙商证券	3,500.00	34,685.00	0.05
256	600655	豫园股份	3,900.00	34,554.00	0.05
257	600219	南山铝业	17,000.00	34,510.00	0.05
258	601018	宁波港	9,547.00	34,082.79	0.05
259	603156	养元饮品	1,564.00	33,626.00	0.05
260	601319	中国人保	5,200.00	33,488.00	0.05
261	600170	上海建工	10,691.00	32,821.37	0.04
262	600674	川投能源	3,504.00	32,482.08	0.04
263	600297	广汇汽车	9,830.00	31,357.70	0.04
264	600208	新湖中宝	10,161.00	30,279.78	0.04
265	601658	邮储银行	6,600.00	30,162.00	0.04
266	002958	青农商行	6,800.00	30,124.00	0.04
267	002939	长城证券	2,400.00	29,568.00	0.04
268	600977	中国电影	2,200.00	28,886.00	0.04
269	002558	巨人网络	1,660.00	28,884.00	0.04
270	600482	中国动力	1,800.00	28,260.00	0.04
271	002468	申通快递	1,601.00	26,272.41	0.04
272	000671	阳光城	4,000.00	25,360.00	0.03
273	601236	红塔证券	1,300.00	25,220.00	0.03
274	000627	天茂集团	4,800.00	25,008.00	0.03
275	600583	海油工程	5,435.00	24,729.25	0.03
276	601992	金隅集团	8,000.00	24,480.00	0.03
277	601633	长城汽车	3,088.00	23,839.36	0.03
278	601698	中国卫通	1,300.00	23,413.00	0.03
279	601238	广汽集团	2,500.00	22,500.00	0.03
280	600188	兖州煤业	2,462.00	21,567.12	0.03
281	601577	长沙银行	2,700.00	21,438.00	0.03
282	601916	浙商银行	5,400.00	21,276.00	0.03
283	601216	君正集团	8,084.00	20,533.36	0.03
284	000709	河钢股份	10,048.00	20,497.92	0.03
285	000723	美锦能源	3,100.00	19,406.00	0.03
286	000708	中信特钢	1,100.00	18,799.00	0.03
287	600989	宝丰能源	2,200.00	18,524.00	0.03
288	600928	西安银行	3,400.00	17,884.00	0.02
289	601898	中煤能源	4,400.00	16,720.00	0.02
290	600025	华能水电	4,400.00	16,676.00	0.02
291	603260	合盛硅业	540.00	14,763.60	0.02
292	601077	渝农商行	3,000.00	14,160.00	0.02

293	601828	美凯龙	1,300.00	13,767.00	0.02
294	002945	华林证券	900.00	12,429.00	0.02
295	600299	安迪苏	1,000.00	12,220.00	0.02
296	601298	青岛港	2,000.00	11,360.00	0.02
297	601212	白银有色	3,700.00	9,435.00	0.01

7.3.2 期末积极投资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	688111	金山办公	2,429.00	829,697.82	1.14
2	688396	华润微	19,761.00	819,093.45	1.12
3	688100	威胜信息	11,602.00	300,723.84	0.41
4	688369	致远互联	2,970.00	234,630.00	0.32
5	688181	八亿时空	3,468.00	211,860.12	0.29
6	688118	普元信息	4,028.00	163,335.40	0.22
7	300839	博汇股份	502.00	11,751.82	0.02
8	300840	酷特智能	1,185.00	7,038.90	0.01

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	300059	东方财富	492,692.92	0.18
2	600309	万华化学	467,252.00	0.17
3	688169	石头科技	389,057.20	0.14
4	600438	通威股份	387,449.00	0.14
5	600745	闻泰科技	386,704.00	0.14
6	603259	药明康德	384,604.00	0.14
7	600031	三一重工	381,932.00	0.14
8	601688	华泰证券	354,117.00	0.13
9	600519	贵州茅台	326,963.00	0.12
10	002352	顺丰控股	326,932.00	0.12
11	601668	中国建筑	325,397.00	0.12
12	600585	海螺水泥	312,767.00	0.12
13	688158	优刻得	294,251.65	0.11
14	300347	泰格医药	284,259.00	0.11
15	601111	中国国航	274,984.00	0.10
16	600030	中信证券	273,208.00	0.10

17	688396	华润微	252,940.80	0.09
18	603986	兆易创新	252,538.00	0.09
19	000977	浪潮信息	243,065.00	0.09
20	600436	片仔癀	224,118.00	0.08

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	601318	中国平安	11,381,593.52	4.21
2	600519	贵州茅台	8,469,558.00	3.13
3	600036	招商银行	5,250,641.00	1.94
4	600276	恒瑞医药	4,266,411.08	1.58
5	000858	五粮液	4,102,926.00	1.52
6	000651	格力电器	3,946,103.30	1.46
7	000333	美的集团	3,879,582.40	1.44
8	601166	兴业银行	3,613,291.00	1.34
9	688111	金山办公	3,485,684.76	1.29
10	600030	中信证券	3,060,578.80	1.13
11	600887	伊利股份	2,627,935.00	0.97
12	000002	万科 A	2,422,271.00	0.90
13	002475	立讯精密	2,225,964.00	0.82
14	600016	民生银行	2,143,863.00	0.79
15	600900	长江电力	2,115,146.40	0.78
16	601328	交通银行	2,086,042.00	0.77
17	601288	农业银行	1,993,297.00	0.74
18	000001	平安银行	1,966,711.00	0.73
19	600000	浦发银行	1,906,383.29	0.71
20	002415	海康威视	1,727,569.00	0.64

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	23,146,730.02
卖出股票的收入（成交）总额	215,619,986.27

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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投资。

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

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

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	21,561.59
2	应收证券清算款	2,047,968.12
3	应收股利	-
4	应收利息	4,303.30
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,073,833.01

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票投资中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688396	华润微	819,093.45	1.12	新股锁定
2	688100	威胜信息	300,723.84	0.41	新股锁定
3	688181	八亿时空	211,860.12	0.29	新股锁定

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

份额级别	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
国投瑞银瑞和沪深 300 指数	7,679	6,057.94	269,614.58	0.58%	46,249,315.71	99.42%
国投瑞银瑞和小康沪深 300 指数	814	11,720.13	40,654.00	0.43%	9,499,531.00	99.57%
国投瑞银瑞和远见沪深 300 指数	909	10,495.25	777.00	0.01%	9,539,408.00	99.99%
合计	9,402	6,977.16	311,045.58	0.47%	65,288,254.71	99.53%

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。

8.2 期末上市基金前十名持有人

国投瑞银瑞和小康沪深300指数

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	梁世友	1,167,668.00	12.24%
2	陈杰	560,852.00	5.88%
3	潘若愚	526,935.00	5.52%
4	柯昌瑞	500,000.00	5.24%
5	周卫东	380,000.00	3.98%
6	孙平	363,938.00	3.81%
7	蔡瑞兰	254,464.00	2.67%
8	夏育林	237,030.00	2.48%
9	苏翠玲	200,002.00	2.10%
10	柯洲	200,000.00	2.10%
11	柯洋	200,000.00	2.10%

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。

国投瑞银瑞和远见沪深300指数

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	吴蕙琳	764,552.00	8.01%
2	兰增美	644,818.00	6.76%
3	苏翠玲	483,842.00	5.07%
4	王娟	419,210.00	4.39%
5	涂光明	265,062.00	2.78%
6	王淑玲	256,496.00	2.69%
7	彭卫东	244,766.00	2.57%
8	王凯	240,671.00	2.52%
9	夏育林	232,486.00	2.44%
10	李莲华	196,376.00	2.06%

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	份额级别	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	国投瑞银瑞和沪深 300 指数	1,451.51	0.00%
	国投瑞银瑞和小康沪深 300 指数	0.00	0.00%
	国投瑞银瑞和远见沪深 300 指数	0.00	0.00%
	合计	1,451.51	0.00%

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。

8.4 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	国投瑞银瑞和沪深 300 指数	0
	国投瑞银瑞和小康沪深 300 指数	0
	国投瑞银瑞和远见沪深 300 指数	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国投瑞银瑞和沪深 300 指数	0
	国投瑞银瑞和小康沪深 300 指数	0

	深 300 指数	
	国投瑞银瑞和远见沪 深 300 指数	0
	合计	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人，本基金基金经理于本报告期末均未持有本基金份额。

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国投瑞银瑞和沪 深 300 指数	国投瑞银瑞和小 康沪深 300 指数	国投瑞银瑞和远 见沪深 300 指数
基金合同生效日（2009 年 10 月 14 日）基金份额总额	257,188,522.99	1,479,367,342.00	1,479,367,342.00
本报告期期初基金份额总额	231,153,036.06	12,278,986.00	12,278,986.00
本报告期基金总申购份额	23,013,934.03	159,967.00	159,967.00
减：本报告期基金总赎回份额	207,648,039.80	2,898,768.00	2,898,768.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	46,518,930.29	9,540,185.00	9,540,185.00

注：总申购份额含配对转换转入份额，总赎回份额含配对转换转出份额。

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 2020 年 6 月 5 日起，张南森先生不再担任公司副总经理；

2、自 2020 年 6 月 23 日起，冯伟女士任公司首席运营官、刘艳梅女士任公司首席国际业务官。

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	
		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
方正证券	1	107,841,732.33	45.78%	100,425.57	45.78%
瑞银证券	2	37,701,602.12	16.01%	35,112.27	16.01%
海通证券	2	23,270,596.52	9.88%	21,672.73	9.88%
东兴证券	1	17,268,031.60	7.33%	16,082.18	7.33%
齐鲁证券	1	16,063,990.71	6.82%	14,959.77	6.82%
中金公司	1	10,443,023.20	4.43%	9,722.05	4.43%
西部证券	1	5,992,632.32	2.54%	5,581.12	2.54%
华创证券	1	5,309,224.90	2.25%	4,944.84	2.25%
兴业证券	1	4,217,077.05	1.79%	3,927.61	1.79%
华泰证券	2	3,907,433.77	1.66%	3,639.20	1.66%
中信证券	2	1,979,175.28	0.84%	1,843.20	0.84%
平安证券	1	844,231.31	0.36%	786.21	0.36%
国信证券	1	720,649.20	0.31%	671.17	0.31%

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
方正证券	396,215.30	58.31%
海通证券	144,010.79	21.19%
东兴证券	94,499.66	13.91%
平安证券	44,816.70	6.60%

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、本基金本报告期未发生交易所回购及权证交易。
- 3、本基金本报告期租用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 对 2020 年春节假期延长期间申购赎回等交易业务及清算交收安排进行提示性公告	中国证监会基金电子披露网站	2020-01-30
2	报告期内基金管理人 对本基金暂停申购（转换转入、定期定额投资）业务、跨系统转托管（场外转场内）业务及场内分拆业务进行公告	证券时报；中国证监会基金电子披露网站	2020-03-23
3	报告期内基金管理人 对推迟披露旗下基金 2019 年年度报告进行公告	上海证券报；中国证券报；证券时报；证券日报；中国证监会基金电子披露网站	2020-03-25
4	报告期内基金管理人 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	2020-06-06
5	报告期内基金管理人 对本基金召开基金份额持有人大会进行公告	证券时报；中国证监会基金电子披露网站	2020-06-19
6	报告期内基金管理人 对公司住所变更进行公告	上海证券报；中国证券报；证券时报；证券日报；中国证监会基金电子披露网站	2020-06-20
7	报告期内基金管理人 对本基金召开基金份额持有人大会进行第一次提示性公告	证券时报；中国证监会基金电子披露网站	2020-06-22
8	报告期内基金管理人 对本基金召开基金份额持有人大会进行第二次提示性公告	证券时报；中国证监会基金电子披露网站	2020-06-23
9	报告期内基金管理人 对基金行业高级管理人员（首席国际业务官）任职进行公告	证券日报；中国证监会基金电子披露网站	2020-06-24
10	报告期内基金管理人 对基金行业高级管理人员（首席运营官）任职进行公告	证券日报；中国证监会基金电子披露网站	2020-06-24

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

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	20200309-20200610	44,918,339.09	44,918,339.09	89,836,678.18	0.00	0.00%
	2	20200101-20200308	66,636,281.68	0.00	66,636,281.68	0.00	0.00%

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。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

《关于核准国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可[2009]865 号）

《关于国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金备案确认的函》（基金部函[2009]666 号）

《国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》
《国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级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
国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金 2020 年中期报告原文

12.2 存放地点

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, 也可按工本费购买复印件

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

二〇二〇年八月二十八日