

# 国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金清算报告

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司

基金托管人：渤海银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年3月30日

清算报告公告日：2018年5月9日

## 一、重要提示

国投瑞银新价值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证监许可【2015】398号文注册募集，于2015年4月22日成立并正式运作，基金托管人为渤海银行股份有限公司。

根据市场环境变化及基金运作情况，为更好地保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）的有关规定，提议终止《基金合同》。

本基金于2018年2月12日至2018年3月14日15:00期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议并表决通过了《关于终止国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本基金的最后运作日为2018年3月15日，本基金于2018年3月16日起进入清算程序。由基金管理人国投瑞银基金管理有限公司、基金托管人渤海银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市源泰律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二、基金概况

1、基金名称：国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金

2、基金简称：国投瑞银新价值混合

3、基金代码：001169

4、基金运作方式：契约型开放式

5、基金合同生效日：2015年4月22日

6、投资目标：在严格控制风险的基础上，通过对不同资产类别的优化配置及组合精选，力求实现基金资产的长期稳健增值。

7、投资策略：本基金将采取主动的类别资产配置策略，注重风险与收益的平衡。本基金将精选具有较高投资价值的股票和债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。

8、业绩比较基准：沪深300指数收益率50%+中债综合指数收益率50%

9、基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司

10、基金托管人：渤海银行股份有限公司

## 三、财务会计报告

### 资产负债表

会计主体：国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年3月15日

单位：人民币元

最后运作日

2018年3月15日

资产：

银行存款 4,640,311.56

结算备付金 41,333.33

存出保证金 184,470.64  
交易性金融资产 1,392,930.00  
其中：股票投资 1,392,930.00  
应收利息 31,674.42  
应收申购款 11,093.34  
资产总计 6,301,813.29  
负债：  
应付赎回款 785,095.01  
应付管理人报酬 3,983.56  
应付托管费 569.09  
应付交易费用 1,530.14  
其他负债 364,453.87  
负债合计 1,155,631.67  
所有者权益：  
实收基金 5,214,490.35  
未分配利润 -68,308.73  
所有者权益合计 5,146,181.62  
负债和所有者权益总计 6,301,813.29

注：报告截止日 2018 年 3 月 15 日(基金最后运作日),基金份额净值 0.987 元,基金份额总额 5,214,490.35 份。

#### 四、清算事项说明

##### 1、基本情况

国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2015]398 号文《关于准予国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由国投瑞银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》向社会公开发行募集，基金合同于 2015 年 4 月 22 日正式生效，首次设立募集规模为 2,401,965,331.60 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，基金托管人为渤海银行股份有限公司。

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、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 50%+中债综合指数收益率 50%。

本基金于 2018 年 2 月 12 日至 2018 年 3 月 14 日 15:00 期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议并表决通过了《关于终止国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。根据本基金基金份额持有人大会通过的议案及议案说明，本基金的最后运作日为 2018 年 3 月 15 日，从 2018 年 3 月 16 日起进入清算期。

##### 2、清算原因

本基金基金份额持有人大会通过《关于终止国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

##### 3、清算起始日

根据《关于国投瑞银新价值灵活配置混合型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》，本基金于 2018 年 3 月 16 日起进入清算程序。由于本基金持有的流通受限股票无法确定变现时间，本基金将进行两次清算，其中第一次清算期间为 2018 年 3 月 16 日至 2018 年 3 月 30 日，第二次清算期间将根

据流通受限股票的变现时间确定。

#### 4、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。基金管理人编制清算报表是为了呈报本基金全体份额持有人以及中国证监会使用。因此，清算报表可能不适用于其他用途。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

#### 五、清算情况

自 2018 年 3 月 16 日至 2018 年 3 月 30 日止的清算期间，本基金基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行第一次清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

##### 1、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金人民币 41,333.33 元，截至 2018 年 3 月 30 日结算备付金余额为人民币 41,333.33 元，该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

(2) 本基金最后运作日存出保证金人民币 184,470.64 元，截至 2018 年 3 月 30 日存出保证金余额为人民币 184,470.64 元，该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 1,392,930.00 元，系因重大事项停牌而未能变现的流通受限股票，其明细如下：

单位：人民币元

股票

代码 股票

名称 停牌

日期 停牌

原因 最后运作日估值单价 数量

(单位:股) 最后运作日

成本总额 最后运作日

估值总额

600309	万华化学	2017/12/5	重大事项	36.18	38,500	1,438,902.00	1,392,930.00
--------	------	-----------	------	-------	--------	--------------	--------------

待停牌股票复牌后，基金管理人将及时变现停牌股票，并于第二次清算时再向基金份额持有人分配。于 2018 年 3 月 30 日，本基金持有停牌股票尚未复牌。

(4) 本基金最后运作日应收利息人民币 31,674.42 元，其中应收银行存款利息人民币 26,242.98 元、应收结算备付金利息人民币 400.22 元及应收存出保证金利息人民币 568.50 元已于 2018 年 3 月 21 日收回并划入本基金托管账户，应收申购款利息人民币 600.03 元及应收赎回款利息人民币 3,862.69 元已于 2018 年 3 月 26 日收回并划入本基金托管账户。截至 2018 年 3 月 30 日应收利息余额为人民币 2,094.35 元，其中应收银行存款利息人民币 1,992.65 元、应收结算备付金利息人民币 18.60 元及应收存出保证金利息人民币 83.10 元，该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

(5) 本基金最后运作日应收申购款人民币 11,093.34 元，该款项已分别于 2018 年 3 月 16 日及 2018 年 3 月 19 日收回并划入本基金托管账户。

##### 2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 785,095.01 元，该款项已分别于 2018 年 3 月 16 日及 2018 年 3 月 19 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 3,983.56 元，该款项已于 2018 年 3 月 20 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 569.09 元，该款项已于 2018 年 3 月 20 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 1,530.14 元，该款项将于第一次清算结束后支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 364,453.87 元，包括应付上海证券报信息披露费人民币

100,000.00 元、应付深圳证券时报信息披露费人民币 200,000.00 元、应付赎回费人民币 206.27 元及应付审计费用人民币 64,247.60 元。其中，应付上海证券报信息披露费人民币 100,000.00 元及应付深圳证券时报信息披露费人民币 200,000.00 元已于 2018 年 3 月 20 日支付；应付赎回费人民币 206.27 元已分别于 2018 年 3 月 16 日及 2018 年 3 月 19 日支付；应付审计费用人民币 64,247.60 元将于第一次清算结束后支付。

### 3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目 自 2018 年 3 月 16 日至

2018 年 3 月 30 日止清算期间

#### 一、清算收益

1、利息收入（注 1） 3,584.75

清算收入小计 3,584.75

#### 二、清算费用

清算费用小计（注 2） -

三、清算净收益 3,584.75

注 1：利息收入系计提的自 2018 年 3 月 16 日至 2018 年 3 月 30 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息及赎回款利息。其中，银行存款利息人民币 1,410.03 元、结算备付金利息人民币 11.13 元及存出保证金利息人民币 49.56 元已于 2018 年 3 月 21 日收回并划入本基金托管账户，赎回款利息人民币 19.68 元已于 2018 年 3 月 26 日收回并划入本基金托管账户。

注 2：根据《关于国投瑞银新价值灵活配置混合型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》，考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的清算费用将由基金管理人承担。

### 4、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目 金额

一、最后运作日 2018 年 3 月 15 日基金净资产 5,146,181.62

加：清算期间净收益 3,584.75

二、2018 年 3 月 30 日基金净资产 5,149,766.37

根据本基金的基金合同及《关于国投瑞银新价值灵活配置混合型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》的约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产交纳所欠税款（如有）并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2018 年 3 月 30 日本基金剩余财产为人民币 5,149,766.37 元，其中包括交易性金融资产人民币 1,392,930.00 元（该金额为停牌股票最后运作日估值金额，与停牌股票资产复牌后实际变现金额可能存在差异），结算备付金及结算保证金人民币 225,803.97 元，2018 年 3 月 21 日至本基金第一次清算结束日的银行存款、结算备付金及结算保证金产生的利息人民币 2,094.35 元。上述剩余未变现的资产将根据变现情况在第二次清算期间按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

截至本报告公告日，本基金持有的因重大事项停牌而未能变现的流通受限股票 600309 万华化学仍未复牌。待停牌股票复牌后，基金管理人将及时变现停牌股票，并于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

2018 年 3 月 21 日（最近结息日）至本基金第二次清算期间的银行存款、结算备付金及结算保证金产生的利息亦属份额持有人所有，为保护基金份额持有人利益，基金管理人国投瑞银基金管理有限公司将于第二次清算款划出日以自有资金垫付相关款项（金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金产生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

截至 2018 年 5 月 8 日，本基金本次可向持有人划拨的清算款为 3,528,938.05 元，将按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。剩余未分配的部分将根据变现及垫付情况在第二次清算期间按基金份额持有

人持有的基金份额比例进行分配。

#### 5、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

#### 六、备查文件

##### 1、备查文件目录

(1) 国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告

(2) 《国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

##### 2、存放地点

基金管理人的办公场所：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>

##### 3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

咨询电话：400-880-6868

国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2018 年 5 月 9 日