

---

国投瑞银和安债券型证券投资基金  
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：中国银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年8月8日

清算报告公告日：2018年9月7日

## 一、 重要提示

国投瑞银和安债券型证券投资基金(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[2016]750号《关于准予国投瑞银和安债券型证券投资基金注册的批复》注册募集,于2016年4月22日成立并正式运作,基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”),基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。

根据《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》、《国投瑞银和安债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,《基金合同》生效后,连续20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,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,本基金合同将终止并进行基金财产清算,且无需召开持有人大会。根据《关于国投瑞银和安债券型证券投资基金基金财产清算及基金合同终止的公告》及《基金合同》,本基金最后运作日为2018年7月23日,于2018年7月24日起进入清算期。

基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2018年7月24日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)对本基金进行清算审计,上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二、 基金概况

基金名称	国投瑞银和安债券型证券投资基金
基金简称	国投瑞银和安债券
基金主代码	002677
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年4月22日
最后运作日(2018年7月23日)基金份额总额	10,013,877.22份
投资目标	在有效控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资人实现超越业绩比较基准的投资业

	绩
投资策略	<p><b>1、资产配置</b></p> <p>本基金采取稳健灵活的投资策略，通过固定收益类金融工具的主动管理，力求降低基金净值波动风险，并根据对股票市场的趋势研判，适度参与股票投资，力求提高基金总体收益率。</p> <p><b>2、债券投资管理</b></p> <p>本基金采取“自上而下”的债券分析方法，确定债券投资组合，并管理组合风险。</p> <p>债券投资策略主要包括：久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略和个券选择策略。在不同的时期，采用以上策略对组合收益和风险的贡献不尽相同，具体采用何种策略取决于债券组合允许的风险程度。</p> <p><b>3、资产支持证券投资策略</b></p> <p>资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，以数量化模型确定其内在价值。</p> <p><b>4、股票投资策略</b></p> <p>基金管理人将把握股票市场出现的趋势性或结构性投资机会，在本基金合同约定范围内直接投资股票市场，努力获取超额收益。在股票投资方面，基金管理人将遵循稳健和灵活兼顾的投资思路。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金

基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国投瑞银和安债券A	国投瑞银和安债券C
下属分级基金的交易代码	002677	002678
最后运作日（2018年7月23日）下属分级基金的份额总额	10,003,738.98份	10,138.24份

### 三、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2016] 750号《关于准予国投瑞银和安债券型证券投资基金注册的批复》注册募集，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于2016年4月19日至2016年4月20日向社会公开募集。本基金基金合同于2016年4月22日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为500,138,595.98份。自2016年4月22日至2018年7月23日期间，本基金正常运作。

根据《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》、《国投瑞银和安债券型证券投资基金基金合同》等有关规定，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，本基金合同将终止并进行基金财产清算。截至2018年7月23日日终，本基金的基金资产净值已连续60个工作日（自2018年4月26日起至2018年7月23日止）低于5000万元，触发基金合同终止情形，基金管理人已就该事项于2018年7月24日刊登了《关于国投瑞银和安债券型证券投资基金基金财产清算及基金合同终止的公告》。本基金从2018年7月24日起进入清算期。

### 四、 财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：国投瑞银和安债券型证券投资基金

报告截止日：2018年7月23日

单位：人民币元

	<b>最后运作日</b> <b>2018年7月23日</b>
--	-----------------------------------

<b>资产：</b>	
银行存款	66,332.12
存出保证金	10,670.07
交易性金融资产	10,849,144.41
其中：股票投资	1,346,347.71
债券投资	9,502,796.70
应收证券清算款	100,008.22
应收利息	132,685.75
资产总计	11,158,840.57
<b>负债：</b>	
应付赎回款	21.83
应付管理人报酬	5,521.33
应付托管费	1,472.36
应付销售服务费	32.54
应付交易费用	7.95
应付税费	101.84
其他负债	22,315.49
负债合计	29,473.34
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	10,013,877.22
未分配利润	1,115,490.01
所有者权益合计	11,129,367.23
负债和所有者权益总计	11,158,840.57

注：报告截止日 2018 年 7 月 23 日（基金最后运作日），国投瑞银和安债券型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 1.1114 元，国投瑞银和安债券型证券投资基金 C 类基金份额净值人民币 1.1039 元，基金份额总额 10,013,877.22，其中国投瑞银和安债券型证券投资基金 A 类基金份额 10,003,738.98 份；国投瑞银和安债券型证券投资基金 C 类基金份额 10,138.24 份。

## 五、 清算情况

自2018年7月24日至2018年8月8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) 本基金最后运作日存出保证金人民币10,670.07元，截至2018年8月8日存出保证金余额为人民币5,961.81元，该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。
- (2) 本基金最后运作日交易性金融资产人民币10,849,144.41元，其中股票投资人民币1,346,347.71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
600485	信威集团	2016/12/26	重大事项停牌	13.59	99,069	1,540,964.00	1,346,347.71

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8月8日，本基金持有停牌股票尚未复牌。

本基金最后运作日债券投资人民币9,502,796.70元，其明细如下：

单位：人民币元

债券代码	债券名称	最后运作日 估值单价	数量 (单位:张)	最后运作日 成本总额	最后运作日 估值总额
010107	21国债(7)	102.56	27,700	2,816,661.09	2,840,912.00
010303	03国债(3)	99.79	13,600	1,316,480.00	1,357,144.00
019536	16国债08	93.00	11,000	1,017,327.38	1,023,000.00
019547	16国债19	89.06	21,670	1,892,431.70	1,929,930.20
136165	16中油02	92.95	9,990	905,774.15	928,570.50
132008	17山高EB	95.64	6,000	562,896.01	573,840.00
132009	17中油EB	98.80	2,500	251,224.56	247,000.00

018005	国开1701	100.40	6,000	602,115.00	602,400.00
--------	--------	--------	-------	------------	------------

以上债券已于自2018年7月24日至2018年8月8日止的清算期间处置变现，处置价款共为人民币9,621,885.48元。

- (3) 本基金最后运作日应收证券清算款人民币100,008.22元，已于2018年7月24日收回并划入本基金托管账户。
- (4) 本基金最后运作日应收利息人民币132,685.75元，包括应收银行存款利息人民币44.42元、应收交易保证金利息人民币17.40元、应收申购款利息人民币13.06元、应收赎回款利息人民币1,764.31元及应收债券利息人民币130,846.56元。其中，应收申购款利息人民币13.06元、应收赎回款利息人民币1,764.31元及应收债券利息人民币130,846.56元已于第一次清算期间收回并划入本基金托管账户。截至2018年8月8日应收利息余额为人民币1,885.94元，其中应收银行存款利息人民币1,862.00元、应收清算备付金利息人民币0.12元及应收交易保证金利息人民币23.82元，该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

## 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21.83元，为本基金持有人于2018年7月20日提交的赎回申请，该款项已于2018年7月24日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币5,521.33元，该款项已于2018年8月2日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币1,472.36元，该款项已于2018年8月2日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付销售服务费人民币32.54元，该款项已于2018年8月2日支付。
- (5) 本基金最后运作日应付交易费用人民币7.95元，该款项将于第二次清算时支付。
- (6) 本基金最后运作日应交税费为人民币101.84元，该款项已于2018年8月3日支付。
- (7) 本基金最后运作日其他负债为人民币22,315.49元，系本基金已预提的应付审计费用，该款项已于2018年8月8日支付。

## 3、 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2018年7月24日至 2018年8月8日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	7,289.28
2、投资收益	120,655.45
3、公允价值变动损益	-137,886.81
清算收入小计	-9,942.08
二、清算支出	
1、交易费用	9.62
2、税金及附加	1.99
3、清算费用（注2）	-
清算支出小计	11.61
三、清算净收益	-9,953.69

注1：利息收入系计提的自2018年7月24日至2018年8月8日止清算期间的银行存款利息、存出保证金利息、清算备付金利息及债券利息。其中，银行存款利息人民币1,817.58元、存出保证金利息人民币6.42元、清算备付金利息人民币0.12元将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

注2：根据《关于国投瑞银和安债券型证券投资基金基金财产清算及基金合同终止的公告》，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，本次清算相关的清算费用由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。

#### 4、清算期间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7月23日基金净资产	11,129,367.23
加：清算期间净收益	-9,953.69
基金赎回款（注1）	-11.08
二、2018年8月8日基金净资产	11,119,402.46



---

注1： 本基金持有人于最后运作日（2018年7月23日）提交的赎回申请，该款项已于2018年7月25日支付。

资产处置及负债清偿后，于2018年8月8日本基金剩余财产为人民币11,119,402.46元，根据本基金的基金合同约定及《关于国投瑞银和安债券型证券投资基金基金财产清算及基金合同终止的公告》，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扣除基金财产清算费用（本基金清算费用由基金管理人承担）、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2018年8月8日本基金剩余财产为人民币11,119,402.46元，其中包括交易性金融资产人民币1,346,347.71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6,416.36元，应收银行存款、结算备付金及结算保证金利息人民币1,885.94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。

因清算款划出日不能确定，暂不能准确预估清算结束日至清算款划出日前一日银行存款产生的利息，该期间利息亦属全体份额持有人所有，将于第二次清算时向基金份额持有人分配。

#### 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，报中国证券监督管理委员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) 《国投瑞银和安债券型证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《国投瑞银和安债券型证券投资基金清算事宜之法律意见》

#### 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

国投瑞银和安债券型证券投资基金基金财产清算小组

2018年9月7日