

---

# 国投瑞银安颐多策略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：中国银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年9月7日

清算报告公告日：2018年10月10日

## 一、 重要提示

国投瑞银安颐多策略混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2016]3175号文注册募集,于2017年3月29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》、《国投瑞银安颐多策略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,《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,且无需召开基金份额持有人大会。根据《关于国投瑞银安颐多策略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8月24日,于2018年8月25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8月25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	国投瑞银安颐多策略混合型证券投资基金
基金简称	国投瑞银安颐多策略混合
基金代码	004287
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月29日
最后运作日(2018年8月24日)基金份额总额	21,136,864.26份
投资目标	在严格控制风险的基础上,采取多种投资策略,力求实现基金资产的长期稳健增值。

投资策略

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、债券投资管理策略及对中小企业私募债券、资产支持证券等的投资策略。

（一）类别资产配置

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各资产类别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。

（二）股票投资管理

股票投资管理包括行业配置策略和优选个股策略。

（三）事件驱动策略

本基金将持续关注事件驱动投资机会，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。

（四）债券投资管理

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。

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。

（五）权证投资管理

- 1、考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率 and 无风险收益率等要素，估计权证合理价值。
- 2、根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即

	<p>“估值差价(Value Price)”以及权证合理价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理价值考量，决策买入、持有或沽出权证。</p> <p>(六) 对于中小企业私募债券，本基金将重点关注发行人财务状况、个券增信措施等因素，以及对基金资产流动性的影响，在充分考虑信用风险、流动性风险的基础上，进行投资决策。</p> <p>(七) 对于资产支持证券，其定价受市场利率、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>
业绩比较基准	中债综合指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

### 三、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2016] 3175 号文注册募集，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于 2017 年 2 月 28 日至 2017 年 3 月 24 日向社会公开募集。本基金基金合同于 2017 年 3 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 614,685,730.68 份。自 2017 年 3 月 29 日至 2018 年 8 月 24 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》、《国投瑞银安颐多策略混合型证券投资基金基金合同》等有关规定，《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，且无需召开基金份额持有人大会。截至 2018 年 8 月 24 日

终，本基金的基金资产净值已连续 60 个工作日（自 2018 年 6 月 1 日起至 2018 年 8 月 24 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 8 月 25 日刊登了《关于国投瑞银安颐多策略基金财产清算及基金合同终止的公告》。本基金从 2018 年 8 月 25 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：国投瑞银安颐多策略混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 8 月 24 日

单位：人民币元

	最后运作日 2018 年 8 月 24 日
资 产：	
银行存款	558,496.92
结算备付金	882,860.55
存出保证金	6,112.49
交易性金融资产	19,503,856.38
其中：股票投资	9,347,296.38
债券投资	10,156,560.00
应收证券清算款	3,096,580.48
应收利息	150,792.53
资产总计	24,198,699.35
负 债：	
应付赎回款	2,109,945.52
应付管理人报酬	28,459.38
应付托管费	5,929.03
应付交易费用	6,671.16
应付税费	547.14
其他负债	13,141.60
负债合计	2,164,693.83
所有者权益：	
实收基金	21,136,864.26
未分配利润	897,141.26
所有者权益合计	22,034,005.52
负债和所有者权益总计	24,198,699.35

注：报告截止日 2018 年 8 月 24 日（基金最后运作日），基金份额净值 1.0424 元，基金份

额总额 21,136,864.26 份。

## 五、 清算情况

自2018年8月25日至2018年9月7日止的清算期间，本基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，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882,860.55元，截至2018年9月7日结算备付金余额为人民币790,564.60元，该款项将于中登结算后转入本基金托管账户。
- (2) 本基金最后运作日存出保证金人民币6,112.49元，该款项已于2018年9月4日转入本基金托管账户。
- (3) 本基金最后运作日交易性金融资产人民币19,503,856.38元，其中股票投资人民币9,347,296.38元，其明细如下：

单位：人民币元

股票代码	股票名称	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
600276	恒瑞医药	67.97	20,300	795,423.20	1,379,791.00
600426	华鲁恒升	17.39	52,600	1,002,121.96	914,714.00
600585	海螺水泥	37.35	41,800	1,314,310.19	1,561,230.00
601225	陕西煤业	7.51	129,900	1,034,292.67	975,549.00
601318	中国平安	62.47	21,700	1,030,456.05	1,355,599.00
000333	美的集团	41.38	27,401	1,102,809.79	1,133,853.38
000651	格力电器	38.94	31,000	1,158,367.12	1,207,140.00
002311	海大集团	19.51	42,000	860,349.00	819,420.00

其中本基金最后运作日债券投资人民币10,156,560.00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
------	------	-------------------	-------------	---------------	---------------

018005	国开1701	100.56	101,000	10,152,180.00	10,156,560.00
--------	--------	--------	---------	---------------	---------------

以上交易性金融资产已于自2018年8月25日至2018年9月7日止的清算期间处置变现，实际变现金额为人民币19,877,564.86元。

- (4) 本基金最后运作日应收证券清算款人民币3,096,580.48元，已于2018年8月27日收回并划入本基金托管账户。
- (5) 本基金最后运作日应收利息人民币150,792.53元，包括应收银行存款利息人民币629.07元、应收清算备付金利息人民币2,710.06元、应收交易保证金利息人民币15.34元、应收申购款利息人民币0.03元、应收赎回款利息人民币368.33元、应收债券利息人民币147,482.14元及应收买入返售到期冲抵利息人民币-412.44元。其中，应收申购款利息人民币0.03元、应收赎回款利息人民币368.33元、应收债券利息人民币147,482.14元及应收买入返售到期冲抵利息人民币-412.44元已于清算期间收回并划入本基金托管账户。其余款项将于结息后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2,109,945.52元，该款项已于2018年8月27日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币28,459.38元，该款项已于2018年8月30日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币5,929.03元，该款项已于2018年8月30日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付交易费用人民币6,671.16元，该款项已于2018年8月30日支付。
- (5) 本基金最后运作日应交税费为人民币547.14元，该款项已于2018年8月29日支付。
- (6) 本基金最后运作日其他负债为人民币13,141.60元，系本基金已预提的银行间账户维护费人民币9,000.00元及应付赎回费人民币4,141.60元。其中，应付赎回费人民币4,141.60元已于2018年8月27日支付。截至2018年9月7日其他负债余额为人民币9,000.00元，系本基金已预提的银行间账户维护费，该款项将于办理银行

间账户销户手续时支付。

### 3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2018年8月25日至 2018年9月7日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	8,999.80
2、投资收益	1,295,013.45
3、公允价值变动损益	-1,053,546.40
4、其他收入	3,260.56
清算收入小计	253,727.41
二、清算费用	
1、交易费用	19,424.60
2、税金及附加	1.33
清算费用小计（注2）	19,425.93
三、清算净收益	234,301.48

注1：利息收入系计提的自2018年8月25日至2018年9月7日止清算期间的银行存款利息、交易保证金利息、赎回款利息、清算备付金利息、买入返售金融资产利息及债券利息。

注2：根据《关于国投瑞银安颐多策略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，除上述交易相关的费用及税金外，其他与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8月24日基金净资产	22,034,005.52
加：清算期间净收益	234,301.48

从持有人权益转入/(转出)	-3,419,445.21
二、2018年9月7日基金净资产	18,848,861.79

资产处置及负债清偿后，于2018年9月7日本基金剩余财产为人民币

18,848,861.79元，根据本基金的基金合同约定及《关于国投瑞银安颐多策略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。

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。将于划出清算款时一并向基金份额持有人分配。为保护基金份额持有人利益，加快清算速度，基金管理人将于清算款划出日前以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异）。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。

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) 《国投瑞银安颐多策略混合型证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《国投瑞银安颐多策略混合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

国投瑞银安颐多策略混合型证券投资基金基金财产清算小组

2018年9月7日