

---

# 国投瑞银新收益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9月12日

清算报告公告日：2018年10月10日

## 一、 重要提示

国投瑞银新收益灵活配置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[2015]1491号文注册募集,于2015年11月17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”),基金托管人为渤海银行股份有限公司(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》、《国投瑞银新收益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,《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《关于国投瑞银新收益灵活配置混合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8月29日,于2018年8月30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30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	国投瑞银新收益灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国投瑞银新收益混合
基金主代码	002039
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月17日
最后运作日(2018年8月29日)基金份额总额	42,611,879.03份
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。
投资策略	<p>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。</p> <p><b>1、类别资产配置</b></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><b>2、股票投资管理</b></p> <p>本基金管理人在进行行业配置时，将采用自上而下与自下而上相结合的方式确定行业权重。在投资组合管理过程中，基金管理人也将根据宏观经济形势以及各个行业的基本面特征对行业配置进行持续动态地调整。</p> <p>本基金构建股票组合的步骤是：根据定量与定性分析确定股票初选库；基于公司基本面全面考量、筛选优势企业，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><b>3、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><b>4、资产支持证券投资策略</b></p> <p>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>

	<p>5、量化投资策略</p> <p>本基金管理人可灵活运用多种量化策略（如多因子模型、统计分析策略、统计套利策略、事件驱动策略、下行风险控制策略等），在严格控制风险的前提下，力争降低组合的波动率并提升组合的风险调整后收益，以达到投资策略的多元化的目的。</p>	
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%。	
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	渤海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国投瑞银新收益混合 A	国投瑞银新收益混合 C
下属分级基金的交易代码	002039	002040
最后运作日（2018 年 8 月 29 日）下属分级基金的份额总额	42,610,063.98 份	1,815.05 份

### 三、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2015]1491 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 2015 年 11 日至 16 日向社会公开募集。本基金基金合同于 2015 年 11 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 2,942,224,498.63 份。自 2015 年 11 月

17日至2018年8月29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》、《国投瑞银新收益灵活配置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29日日终，本基金的基金份额持有人数量已连续60个工作日（自2018年6月6日起至2018年8月29日止）不满200人，触发了上述基金合同终止的情形，基金管理人已就该事项于2018年8月30日刊登了《关于国投瑞银新收益灵活配置混合型证券投资基金财产清算及基金合同终止的公告》，本基金从2018年8月30日起进入清算期。由于本基金持有的流通受限股票无法确定复牌及变现时间，本基金计划将进行两次清算，其中第一次清算期间为2018年8月30日至2018年9月12日，第二次清算期间将根据流通受限股票的变现时间确定。

#### 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：国投瑞银新收益灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年8月29日

单位：人民币元

	最后运作日 2018年8月29日
<b>资产：</b>	
银行存款	41,407,445.97
结算备付金	2,109,090.91
存出保证金	186,371.03
交易性金融资产	2,138,848.27
其中：股票投资	2,138,848.27
应收利息	229,912.35

资产总计	46,071,668.53
<b>负债：</b>	
应付赎回款	31.98
应付管理人报酬	39,351.65
应付托管费	6,558.63
应付销售服务费	0.90
应付交易费用	97,721.76
应交税费	470.89
其他负债	27,247.09
负债合计	171,382.90
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	42,611,879.03
未分配利润	3,288,406.60
所有者权益合计	45,900,285.63
负债和所有者权益总计	46,071,668.53

注：报告截止日 2018 年 8 月 29 日（基金最后运作日），国投瑞银新收益混合 A 类基金份额净值人民币 1.0772 元，国投瑞银新收益混合 C 类基金份额净值人民币 1.0545 元，基金份额总额 42,611,879.03 份，其中国投瑞银新收益混合 A 类基金份额 42,610,063.98 份；国投瑞银新收益混合 C 类基金份额 1,815.05 份。

## 五、 清算情况

自2018年8月30日至2018年9月12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2,109,090.91元，截至2018年9月12日结算备付金余额为人民币286,956.52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186,371.03元，截至2018年9月12日存出保证金余额为人民币136,933.50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2,138,848.27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
300197	铁汉生态	2018/5/28	重大事项	4.81	444,667	4,256,935.20	2,138,848.27

于2018年9月12日,本基金持有停牌股票尚未复牌。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。

(4) 本基金最后运作日应收利息人民币229,912.35元,包括应收银行存款利息人民币208,660.05元、应收结算备付金利息人民币3,921.09元、应收结算保证金利息人民币541.05元及应收赎回款利息人民币16,790.16元,其中应收赎回款利息人民币16,790.16元已于2018年9月5日收回并划入本基金托管账户。截至2018年9月12日应收利息余额为人民币240,628.95元,其中应收银行存款利息人民币235,394.45元、应收结算备付金利息人民币4,593.83元及应收存出保证金利息人民币640.67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31.98元,该款项已于2018年8月30日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币39,351.65元,该款项已于2018年9月4日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币6,558.63元,该款项已于2018年9月4日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币0.90元,该款项已于2018年9月4日支付。
- (5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币97,721.76元。其中,应付银行间交易手续费费用人民币212.50元已于2018年9月5日支付;剩余款项将于第一次清算结束后支付。
- (6) 本基金最后运作日应付税费用为人民币470.89元,该款项已于2018年9月10日支付。
- (7) 本基金最后运作日其他负债为人民币27,247.09元,系应付审计费用,该款项已

于2018年8月31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8月30日至 2018年9月12日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	27,506.76
清算收入小计	27,506.76
二、清算费用	
清算费用小计（注2）	-
三、清算净收益	27,506.76

注1：利息收入系计提的自2018年8月30日起至2018年9月12日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息。其中，银行存款利息人民币26,734.40元、结算备付金利息人民币672.74元及存出保证金利息人民币99.62元。

注2：根据《关于国投瑞银新收益灵活配置混合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，本基金的清算费用将由基金管理人承担。

### 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29日基金净资产	45,900,285.63
加：清算期间净收益	27,506.76
二、2018年9月12日基金净资产	45,927,792.39

根据本基金的基金合同及《关于国投瑞银新收益灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算及基金合同终止的公告》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（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9月12日本基金剩余财产为人民币45,927,792.39元，其中包括未变现资产：交易性金融资产人民币2,138,848.27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），结算备付金人民币286,956.52元及存出保证金人民币136,933.50元，应收银行存款、结算备付金及存出保证金利息人民币240,628.95元。上述剩余未变现的资产将根据变现情况在第二次清算时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，将在第二次清算时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) 《国投瑞银新收益灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《国投瑞银新收益灵活配置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

国投瑞银新收益灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2018年9月12日

