

国投瑞银优选收益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：中国银河证券股份有限公司

清算报告出具日：2019年4月10日

清算报告公告日：2019年5月29日

一、重要提示

国投瑞银优选收益混合型证券投资基金(以下简称"本基金")于2018年10月9日经基金份额持有人大会决议,由国投瑞银优选收益灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来,国投瑞银优选收益灵活配置混合型证券投资基金系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[2015]404号文注册募集,于2015年4月16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河证券股份有限公司(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》、《国投瑞银优选收益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《关于国投瑞银优选收益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2019年3月27日,于2019年3月28日起进入清算期。

基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2019年3月28日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所(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 国投瑞银优选收益混合型证券投资基金

基金简称 国投瑞银优选收益混合

基金代码 001168

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2018年10月9日

最后运作日(2019年3月27日)基金份

额总额 1,421,491.42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

本基金的投资策略包括类别资产配置策略、股票投资管理策略、债券投资管理策略等。

(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。

(二) 股票投资管理

1、行业配置策略

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。

2、优选个股策略

本基金将采用定量与定性分析相结合的方式确定股票初选库。定量分析方面，基金管理人将综合考虑个股的价值程度、成长能力、盈利趋势、价格动量等量化指标对个股进行初选。

本基金严格遵循“价格/内在价值”的投资理念。虽然证券的市场价格波动不定，但随着时间的推移，价格一定会反映其内在价值。

（三）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。

1、基本价值评估

债券基本价值评估的主要依据是均衡收益率曲线。基于均衡收益率曲线，计算不同资产类别、不同剩余期限配置的预期超额回报，并对预期超额回报进行排序，得到投资评级。在此基础上，卖出内部收益率低于均衡收益率的债券，买入内部收益率高于均衡收益率的债券。

2、债券投资策略

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。

3、组合构建及调整

本公司债券策略组将结合各成员债券投资管理经验，评估债券价格与内在价值偏离幅度是否可靠，据此构建债券投资组合。

业绩比较基准 沪深 300 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%

风险收益特征 本基金为混合型基金，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 中国银河证券股份有限公司

三、基金运作情况

本基金于 2018 年 10 月 9 日经基金份额持有人大会决议，由国投瑞银优选收益灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来，国投瑞银优选收益灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2015]404 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 4 月 13 日至 2015 年 4 月 14 日向社会公开募集，于 2015 年 4 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 3,355,108,954.54 份。自 2015 年 4 月 16 日至 2019 年 3 月 27 日期间，国投瑞银优选收益灵活配置混合型证券投资基金及变更注册后的本基金正常运作。

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》、《国投瑞银优选收益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。截至 2019 年 3 月 27 日终，本基金的基金资产净值已连续 60 个工作日（自 2018 年 12 月 25 日起至 2019 年 3 月 27 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 2019 年 3 月 28 日刊登了《关于国投瑞银优选收益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》。本基金从 2019 年 3 月 28 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：国投瑞银优选收益混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 3 月 27 日

单位：人民币元

最后运作日

2019 年 3 月 27 日

资 产：

银行存款 4,131,643.89

结算备付金 -

存出保证金 3,080.68

交易性金融资产 -

应收证券清算款 -

应收利息 1,396.99

资产总计 4,136,121.56

负 债：

应付赎回款 2,618,971.74

应付管理人报酬 2,001.20

应付托管费 333.55

应付交易费用 -

应付税费 -

其他负债 25,040.07

负债合计 2,646,346.56

所有者权益：

实收基金 1,421,491.42

未分配利润 68,283.58

所有者权益合计 1,489,775.00

负债和所有者权益总计 4,136,121.56

注：报告截止日 2019 年 3 月 27 日（基金最后运作日），基金份额净值 1.0480 元，基金份额总额 1,421,491.42 份。

五、清算情况

自 2019 年 3 月 28 日至 2019 年 4 月 10 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) 本基金最后运作日存出保证金人民币 3,080.68 元，并于 2019 年 4 月 2 日调增上交所交易保证金人民币 21.22 元。截止本基金清算终止日（2019 年 4 月 10 日）存出保证金余额为人民币 3,101.90 元，该款项将于中登结算后转入本基金托管账户。

(2) 本基金最后运作日应收利息人民币 1,396.99 元，包括应收银行存款利息人民币 1,395.85 元、应收上海交易保证金利息人民币 0.98 元、应收申购款利息人民币 0.16 元。其中，应收申购款利息人民币 0.16 元已于 2019 年 4 月 2 日收回并划入本基金托管账户，剩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 2,618,971.74 元, 该款项已于 2019 年 3 月 28 日支付。

(2)本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 2,001.20 元, 该款项已于 2019 年 4 月 4 日支付。

(3)本基金最后运作日应付托管费为人民币 333.55 元, 该款项已于 2019 年 4 月 4 日支付。

(4)本基金最后运作日其他负债为人民币 25,040.07 元, 系本基金已预提的审计费人民币 25,000.00 元及应付赎回费人民币 40.07 元。其中, 应付赎回费人民币 40.07 元已于 2019 年 3 月 28 日支付, 预提审计费将于清算终止日后支付。

3、清算期间的清算损益情况

单位: 人民币元

项目 自 2019 年 3 月 28 日至
2019 年 4 月 10 日止清算期间

一、清算收益

1、利息收入(注 1) 1,584.31

2、投资收益 -

3、公允价值变动损益 -

4、其他收入(注 2) 30.21

清算收入小计 1,614.52

二、清算费用

清算费用小计(注 3) -

三、清算净收益 1,614.52

注 1: 利息收入系计提的自 2019 年 3 月 28 日至 2019 年 4 月 10 日止清算期间的银行存款利息、交易保证金利息, 以及于 2019 年 4 月 2 日收到的自 2018 年 12 月 22 日至 2019 年 4 月 1 日止期间的赎回款利息。

注 2: 其他收入系本基金持有人于最后运作日(2019 年 3 月 27 日)提交的赎回申请产生的赎回费收入。

注 3: 根据《关于国投瑞银优选收益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 2019 年 3 月 27 日基金净资产 1,489,775.00

加: 清算期间净收益 1,614.52

减: 清算期间持有人权益转出(注) 687,462.06

二、2019 年 4 月 10 日基金净资产 803,927.46

注: 该项系本基金持有人于最后运作日(2019 年 3 月 27 日)提交的赎回申请, 相应赎回款项已于 2019 年 3 月 29 日支付。

根据本基金的基金合同约定及《关于国投瑞银优选收益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》, 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前一日银行存

款及存出保证金产生的利息，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）及存出保证金。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)《国投瑞银优选收益混合型证券投资基金清算审计报告》
- (2)《国投瑞银优选收益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

国投瑞银优选收益混合型证券投资基金基金财产清算小组

2019 年 5 月 29 日