

---

# 国投瑞银瑞兴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：中国建设银行股份有限公司

清算报告出具日：2019年5月10日

清算报告公告日：2019年6月18日

## 一、 重要提示

国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由原国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金于2018年1月6日转型而来,国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2015]2777号文《关于准予国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册。本基金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”),基金托管人为中国建设银行股份有限公司(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》、《国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,本基金于2019年3月12日至2019年4月15日上午10:00期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会,会议审议并通过了《关于终止国投瑞银瑞兴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《关于国投瑞银瑞兴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》及《基金合同》,本基金最后运作日为2019年4月16日,于2019年4月17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4月17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	国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国投瑞银瑞兴混合
基金主代码	002242
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年1月6日
最后运作日(2019年4月16日)基金份额总额	18,598,572.47份
投资目标	在追求有效控制风险和保持资金流动性的基础上,在风险有效控制前提下,根据宏观经济周期和市场

	<p>环境的变化，依据股票市场和债券市场之间的相对风险收益预期，自上而下灵活配置资产，积极把握行业发展趋势和风格轮换中蕴含的投资机会，力求实现基金资产的长期稳定增值。</p>
投资策略	<p>本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上，动态调整投资组合比例，自上而下灵活配置资产；通过把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化，挖掘预期具有良好增长前景的优势行业，精选个股，以谋求超额收益。</p> <p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金将采用“自上而下”的多因素分析决策支持系统，根据股票和债券等固定收益类资产的市场趋势和预期收益风险的比较判别，对其配置比例进行灵活动态调整，以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金的股票投资策略主要采用“自下而上”选股策略，辅以“自上而下”的行业分析进行组合优化。</p> <p>（三）债券组合构建</p> <p>本基金借鉴 UBS AM 固定收益组合的管理方法，采取“自上而下”的债券分析方法，确定债券模拟组合，并管理组合风险。</p> <p>（四）衍生品投资策略</p> <p>为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。</p>
业绩比较基准	<p>沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%</p>
风险收益特征	<p>本基金为灵活配置的混合型基金，风险与预期收益高于货币型基金和债券型基金，低于股票型基金。</p>

基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

### 三、 基金运作情况

本基金由原国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金于 2018 年 1 月 6 日转型而来，国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2015]2777 号文《关于准予国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册。本基金基金合同生效日的基金份额总数为 94,747,359.77 份。自 2018 年 1 月 6 日至 2019 年 4 月 16 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》、《国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金于 2019 年 3 月 12 日至 2019 年 4 月 15 日上午 10:00 期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议并通过了《关于终止国投瑞银瑞兴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《关于国投瑞银瑞兴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》及《基金合同》，本基金最后运作日为 2019 年 4 月 16 日，于 2019 年 4 月 17 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：国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 4 月 16 日

单位：人民币元

	最后运作日 2019 年 4 月 16 日
<b>资产：</b>	
银行存款	18,592,073.78
结算备付金	26,666.67
结算保证金	8,608.91
应收利息	12,902.19
<b>资产总计</b>	<b>18,640,251.55</b>

<b>负债：</b>	
应付赎回款	715,491.38
应付管理人报酬	14,938.13
应付托管费	2,489.66
应交税费	
其他负债	5,000.00
<b>负债合计</b>	<b>737,919.17</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	18,598,572.47
未分配利润	-696,240.09
<b>所有者权益合计</b>	<b>17,902,332.38</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>18,640,251.55</b>

注：报告截止日 2019 年 4 月 16 日(基金最后运作日)，基金份额净值 0.9626 元，基金份额总额 18,598,572.47 份。

## 五、 清算情况

自2019年4月17日至2019年5月10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保证金人民币8,608.91元，结算备付金人民币26,666.67元，该两笔款项将按照中登结算规则，于2019年5月7日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12,902.19元，包括应收银行存款利息人民币11,901.86元、应收上海结算备付金利息人民币16.80元、应收深圳结算保证金利息人民币2.56元、应收上海结算保证金利息人民币4.94元、应收申购款利息人民币399.94元及应收赎回款利息人民币576.09元。其中，应收申购款利息人民币399.94元及应收赎回款利息人民币576.09元于2019年4月23日收回并划入本基金托管账户。截至2019年5月10日应收利息余额为人民币20,502.98元，其中应收银行存款利息人民币20,445.29元、应收深圳中登结算保证金利息人民币5.50元、应

收上海中登结算保证金利息人民币10.19元、应收上海中登最低备付金利息人民币42.00元。该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715,491.38元，该款项于2019年4月17日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币14,938.13元，该款项于2019年5月7日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币2,489.66元，该款项于2019年5月7日支付。
- (4) 本基金最后运作日其他负债为人民币5,000.00元，系本基金已预提的审计费，该费用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4月17日至 2019年5月10日止清算期间
一、清算收益	
1. 利息收入（注1）	8,593.54
2. 其他收入（注2）	1.21
清算收入小计	8,594.75
二、清算费用	-
清算费用小计（注3）	-
三、清算净收益	8,594.75

注1：利息收入系计提的自2019年4月17日至2019年5月10日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、结算保证金利息及赎回款利息。其中，银行存款利息人民币8,543.43元、结算备付金利息人民币25.20元、结算保证金利息人民币8.19元、赎回款利息收入人民币16.72元。

注2：其他收入系本基金持有人于最后运作日（2019年4月16日）提交的赎回申请产生的赎回费收入。

注3：根据《关于终止国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项议案的说明》，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2019年4月16日基金净资产	17,902,332.38
减：清算期间持有人权益转出(注)	120,618.59
加：清算期间净收益	8,594.75
二、2019年5月10日基金净资产	17,790,308.54

注：该项系本基金持有人于最后运作日（2019年4月16日）提交的赎回申请，相应赎回款项已于2019年4月18日支付。

根据本基金的基金合同约定及《关于国投瑞银瑞兴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》，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）《国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
- （2）《国投瑞银瑞兴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

国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2019年5月10日