
国投瑞银兴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：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2020年01月17日

清算报告公告日：2020年01月21日

一、 重要提示

国投瑞银兴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[2017]2194号文核准募集,于2018年02月08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”),基金托管人为中国工商银行股份有限公司(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》、《国投瑞银兴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《关于国投瑞银兴颐多策略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12月12日,于2019年12月13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2019年12月13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	国投瑞银兴颐多策略混合型证券投资基金
基金简称	国投瑞银兴颐多策略混合
基金主代码	005499
交易代码	005499
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月8日
最后运作日(2019年12月12日)基金份额总额	16,323,246.27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

	<p>求实现基金资产的长期稳健增值。</p>
<p>投资策略</p>	<p>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、主题投资策略、红利投资策略、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。</p> <p>（一）类别资产配置</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。</p> <p>（二）股票投资管理</p> <p>股票投资管理包括行业配置策略和优选个股策略。</p> <p>（三）主题投资策略</p> <p>本基金从宏观经济、政策制度、社会文化、科技发展等多角度出发，通过深入研究经济发展和资本市场趋势变化，挖掘中长期和阶段性主题投资机会。本基金将结合主题方向进行合理细致的分析，并从中精选出受益的行业和上市公司，力争在控制风险的基础上获取超额收益。</p> <p>（四）红利投资策略</p> <p>长期以来，上市公司分红制度是市场基础性制度建设的重要范畴，上市公司现金分红政策的执行得到不断地提升和完善，同时，持续分红的公司提供了相对较高的安全边际，具有较好的防御性。本基金将重点关注股息率高、分红稳定的上市公司，并从中挑选未来盈利能力良好、分红潜力较大的优质上市公司，结合市场环境进行适当配置。</p> <p>（五）债券投资管理</p> <p>本基金采取“自上而下”的债券分析方法，确定债</p>

	<p>券投资组合，并管理组合风险。</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，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	中国工商银行股份有限公司

三、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2017]2194 号文核准募集，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于 2018 年 01 月 10 日至 2018 年 02 月 02 日向社会公开募集。本基金基金合同于 2018 年 02 月 08 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 281,783,280.35 份。自 2018 年 02 月 08 日至 2019 年 12 月 12 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》、《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 12 月 12 日日终，本基金的基金资产净值已连续 60 个工作日低于 5000 万元，触发了上述基金合同终止的情形，基金合同自动终止，基金管理人已就该事项于 2019 年 12 月 13 日刊登了《关于国投瑞银兴颐多策略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 12 月 13 日起进入清算期。由于本基金持有的流通

受限证券无法确定变现时间，本基金计划将进行两次清算，其中第一次清算期间为 2019 年 12 月 13 日至 2020 年 01 月 17 日，第二次清算期间将根据流通受限证券的变现时间确定。

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：国投瑞银兴颐多策略混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 12 日

单位：人民币元

	最后运作日 2019 年 12 月 12 日
资产：	
银行存款	2,053,918.01
结算备付金	28,086.36
存出保证金	15,756.19
交易性金融资产	16,442,412.71
其中：股票投资	6,216,659.71
债券投资	10,225,753
应收利息	182,377.74
应收证券清算款	-
资产总计	18,722,551.01
负债：	
应付赎回款	920,303.85
应付管理人报酬	9,413.09
应付托管费	1,568.84
应付交易费用	28,097.44
应交税费	1,337.09
其他负债	92,599.94
负债合计	1,053,320.25
所有者权益：	
实收基金	16,323,246.27
未分配利润	1,345,984.49
所有者权益合计	17,669,230.76
负债和所有者权益总计	18,722,551.01

注：报告截止日 2019 年 12 月 12 日（基金最后运作日），基金份额净值 1.0825 元，基金份额总额 16,323,246.27 份。

五、 清算情况

自2019年12月13日至2020年01月17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28,086.36元。截至2020年01月17日结算备付金余额为人民币6,852.97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15,756.19元，该款项已于2020年01月03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16,442,412.71元，其中股票投资人民币6,216,659.71元，债券投资人民币10,225,753.00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
601166	兴业银行	19.23	20,800	364,832.00	399,984.00
601607	上海医药	17.46	25,000	455,888.00	436,500.00
603799	华友钴业	30.10	15,000	465,960.00	451,500.00
000002	万科A	28.00	34,100	924,519.00	954,800.00
000651	格力电器	61.48	6,800	375,648.52	418,064.00
000786	北新建材	23.25	19,594	381,718.86	455,560.50
002008	大族激光	37.90	12,100	387,533.50	458,590.00
002027	分众传媒	5.53	85,800	457,483.25	474,474.00
002304	洋河股份	98.44	7,500	803,155.00	738,300.00
002597	金禾实业	20.25	18,500	371,625.00	374,625.00
002952	亚世光电	29.69	35,509	737,177.22	1,054,262.21
122803	PR滁建投	62.26	25,000	1,563,936.79	1,556,500.00
136732	16穗建05	100.26	20,000	1,963,664.11	2,005,200.00
143669	18宁开控	106.97	14,900	1,594,000.96	1,593,853.00
018006	国开1702	102.20	10,000	1,016,693.10	1,022,000.00
018007	国开1801	100.62	10,000	1,008,000.00	1,006,200.00
101756015	17柳州城投 MTN001	101.42	10,000	1,025,189.40	1,014,200.00
101900147	19桂投资 MTN001	101.39	20,000	2,000,000.00	2,027,800.00

本基金于自2019年12月13日至2020年01月17日止的清算期间对可变现的交易性金融资产进行处置变现，实际变现金额为人民币15,765,516.26元；截至2020年01月17日，本基金持有的流通受限股票明细如下：

单位：人民币元

股票代码	股票名称	清算结束日 估值单价	数量 (单位:股)	清算结束日 成本总额	清算结束日 估值总额
002952	亚世光电	32.41	35,509	737,177.22	1,150,846.69

注：截至01月03日除亚世光电外，其余交易性金融资产均已变现。为了加快清算速度，亚世光电清算结束日估值单价为2020年01月03日之估值价，后续变现以实际金额为准。

该股票为2019年3月20日基金因认购新发证券持有的流通受限证券，锁定期为12个月。第一次清算期间仍处于锁定期。待该股票限售期满时，基金管理人将及时变现流通受限股票，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182,377.74元，包括应收银行存款利息人民币5,929.30元、应收结算备付金利息人民币469.72元、应收存出保证金利息人民币64.49元及应收债券利息人民币175,914.23元。其中，应收债券利息人民币175,914.23元，该款项已于第一次清算期间收回并划入本基金托管账户。

截至2020年01月17日应收利息余额为人民币7,626.26元，其中应收银行存款利息人民币7,596.44元、应收结算备付金利息人民币20.72元及应收存出保证金利息人民币9.10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920,303.85元，该款项已于2019年12月13日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币9,413.09元，该款项已于2020年01月02日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币1,568.84元，该款项已于2020年01月02日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币28,097.44元，该款项已于2020年01月06

日支付。截至2020年01月17日，应付交易费用余额为人民币307.50元，该款项将于第二次清算时支付。

(5) 本基金最后运作日应交税费为人民币1,337.09元，该款项已于2020年01月06日支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币92,599.94元，包括应付赎回费人民币1,730.08元、预提信息披露费人民币41,369.86元、预提审计费用人民币40,000.00元、预提银行间账户维护费人民币9,500.00元。其中，应付赎回费已于2019年12月13日支付，预提信息披露费已于2019年12月16日支付，预提审计费用已于2019年12月13日支付，预提银行间账户维护费人民币4,565元已于2019年12月13日和2019年12月27日支付。截至2020年01月17日，其他负债余额为人民币4,935.00元，系预提银行间账户维护费，该款项将于第二次清算时支付。

3、 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2019年12月13日至 2020年01月17日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	17,523.22
2、投资收益（注2）	610,711.51
3、公允价值变动损益（注3）	-131,718.53
4、其他收入（注4）	351.33
清算收益小计	496,867.53
二、清算支出	
1、交易费用（注5）	11,550.21
2、税金及附加	28.76
3、清算费用（注6）	-
清算支出小计	11,578.97
三、清算净收益	485,288.56

注1：利息收入系计提的自2019年12月13日起至2020年01月17日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息及债券利息。其中，银行存款利息人民币8,269.74元、结算备付金利息人民币32.22元、存出保证金利息15.38元，债券利息人民币9,205.88元已于2019年12月31日和2020年01月17日收回并划入本基金托管账户。

注2：投资收益人民币610,711.51元，系第一次清算期间股票差价收入、债券差价收入和股利收入。

注3：公允价值变动损益人民币-131,718.53元，系第一次清算期间股票和债券投资的公允价值变动损益。

注4：其他收入系最后运作日基金份额持有人发生赎回业务产生的赎回费收入。

注5：交易费用系卖出证券产生的费用。

注6：根据《关于国投瑞银兴颐多策略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2019年12月12日基金净资产	17,669,230.76
加：清算期间净收益	485,288.56
清算期间从持有人权益转出（注1）	-561,940.07
二、2020年01月17日基金净资产	17,592,579.25

注1：本基金份额持有人于最后运作日（2019年12月12日）提交的赎回申请，已于2019年12月16日支付基金赎回款。

根据本基金的《基金合同》及《关于国投瑞银兴颐多策略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。

2020年01月17日本基金剩余财产为人民币17,592,579.25元，其中剩余未变现的资产为1,165,325.92元，包括交易性金融资产人民币1,150,846.69元（该金额为流通受限证券最后运作日估值金额，与实际变现金额可能存在差异），结算备付金人民币6,852.97元，应收银行存款、结算备付金及存出保证金利息人民币7,626.26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，将于第二次清算结束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) 《国投瑞银兴颐多策略混合型证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《上海源泰律师事务所关于国投瑞银兴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

国投瑞银兴颐多策略混合型证券投资基金基金财产清算小组

2020年01月17日