
国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金 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07月15日

清算报告公告日：2020年07月17日

一、 重要提示

国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2012]440号核准募集,于2015年03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”),基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。

根据市场环境变化及基金运作情况,为更好地保护基金份额持有人的利益,基金管理人依据《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》和《国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,提议终止《基金合同》。

本基金于2020年05月14日至2020年06月23日上午10:00期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会,会议审议并表决通过了《关于终止国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同及国投创业成长A份额和国投创业成长B份额终止上市有关事项的议案》。本基金的最后运作日为2020年06月24日,于2020年06月25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2020年06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

基金简称	国投瑞银中证创业指数分级
基金主代码	161223
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年03月17日
报告期末基金份额总额	13,026,429.25份
投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理,实现对中证创业成长指数的有效跟踪,力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内,年跟踪误差控

	制在 4%以内。		
投资策略	<p>本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪基准指数。</p> <p>当预期指数成份股调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为时，或者因特殊情况（如股权分置改革等）导致基金无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差。</p> <p>为有效控制指数的跟踪误差，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。</p>		
业绩比较基准	95%×中证创业成长指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）		
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。</p> <p>从本基金所分离的两类基金份额，国投创业成长 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；国投创业成长 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。</p>		
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	国投瑞银中证创业指数分级	国投瑞银中证创业指数分级 A	国投瑞银中证创业指数分级 B
下属分级基金的场内简称	国投成长	成长 A 级	成长 B 级
下属分级基金的交易代	161223	150213	150214

码			
报告期末下属分级基金的份额总额	2,678,123.25 份	5,174,153.00 份	5,174,153.00 份

三、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2012]440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2015年03月09日至2015年03月11日向社会公开募集。本基金基金合同于2015年03月17日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为219,446,987.21份。自2015年03月17日至2020年06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》、《国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》等有关规定，经本基金份额持有人大会2020年06月23日表决通过，决定终止基金合同，并对本基金进行变现及清算程序。本基金从2020年06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：国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金

报告截止日：2020年06月24日

单位：人民币元

	最后运作日 2020年06月24日
资产：	
银行存款	1,278,280.36
结算备付金	824,256.55
存出保证金	10,947.21
交易性金融资产	18,552.00
其中：股票投资	18,552.00
应收利息	1,694.28

应收证券清算款	20,424,076.03
资产总计	22,557,806.43
负债：	
应付赎回款	86,542.18
应付管理人报酬	14,824.59
应付托管费	3,261.40
其他负债	55,916.83
负债合计	231,835.23
所有者权益：	
实收基金	29,548,842.15
未分配利润	-7,222,870.95
所有者权益合计	22,325,971.20
负债和所有者权益总计	22,557,806.43

注：截至 2020 年 06 月 24 日(基金最后运作日)，国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金之基础份额净值 1.714 元，国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金之 A 类份额参考净值 1.024 元，国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金之 B 类份额参考净值 2.404 元，国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金之基金份额总额 13,026,429.25 份，其中国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金之基础份额 2,678,123.25 份，国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金之 A 类份额 5,174,153.00 份，国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金之 B 类份额 5,174,153.00 份。

五、 清算情况

自2020年06月25日至2020年07月15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) 银行存款

于2020年06月24日(基金最后运作日)，本基金的银行存款均为活期存款。

(2) 结算备付金

本基金2020年06月24日(基金最后运作日)的结算备付金余额为人民币824,256.55元，其中人民币762,315.59元已于2020年07月02日划入本基金托管账户。

截止本资产负债表批准报出日(2020年07月15日)结算备付金余额为人民币61,940.96元。

(3) 存出保证金

本基金2020年06月24日(基金最后运作日)的存出保证金余额为人民币10,947.21元，该款项已于2020年07月02日划入本基金托管账户。

(4) 交易性金融资产

本基金2020年06月24日(基金最后运作日)的交易性金融资产余额为人民币18,552.00元，系本基金持有的股票投资，其明细如下：

金额单位：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
603666	亿嘉和	77.30	240	12,638.66	18,552.00

以上交易性金融资产已于自2020年06月25日至2020年07月15日止的清算期间处置变现，实际变现金额为人民币18,372.00元(不含交易费用)。

(5) 应收利息

本基金2020年06月24日(基金最后运作日)的应收利息余额为人民币1,694.28元，其中应收申购款利息余额人民币1,544.74元已于2020年07月03日划入本基金托管账户。

截止本资产负债表批准报出日(2020年07月15日)应收利息余额为人民币4,363.61元，其中应收活期存款利息余额人民币3,908.42元、应收结算备付金利息余额人民币449.69元、应收存出保证金利息余额人民币5.50元。

(6) 应收证券清算款

本基金2020年06月24日(基金最后运作日)的应收证券清算款余额为人民币20,424,076.03元，该款项已于2020年06月29日划入本基金托管账户。

2、 负债清偿情况

(1) 应付赎回款

本基金2020年06月24日(基金最后运作日)的应付赎回款余额为人民币86,542.18元,该款项已于2020年06月29日支付。

(2) 应付管理人报酬

本基金2020年06月24日(基金最后运作日)的应付管理人报酬余额为人民币14,824.59元,该款项已于2020年07月02日支付。

(3) 应付托管费

本基金2020年06月24日(基金最后运作日)的应付托管费余额为人民币3,261.40元,该款项已于2020年07月02日支付。

(4) 应付交易费用

本基金2020年06月24日(基金最后运作日)的应付交易费用余额为人民币71,290.23元,该款项已于2020年07月02日支付。

(5) 其他负债

本基金2020年06月24日(基金最后运作日)的其他负债余额为人民币55,916.83元,其中,应付赎回费余额人民币129.24元已于2020年06月29日支付,审计费用余额人民币19,235.04元、预提上市费余额人民币35,000.00元已于2020年07月02日支付。截止本资产负债表批准报出日(2020年07月15日)其他负债余额为人民币1,439.55元,其中,应付指数使用费余额人民币1,252.55元、其他应付款余额人民币187.00元,上述款项将于本资产负债表批准报出日(2020年07月15日)后支付。

3、 清算期间的清算损益情况

单位:人民币元

项目	附注	2020年06月25日至2020年07月15日止清算期间
一、清算收益		1,303.35
1、利息收入	(1)	4,214.07
2、投资收益(损失以“-”填列)	(2)	2,922.94
3、公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	(3)	-5,913.34
4、其他收入(损失以“-”号填列)	(4)	79.68
二、清算支出		37.10
1、交易费用	(5)	37.10
2、清算费用	(6)	-

三、清算净收益		1,266.25
----------------	--	-----------------

注（1）利息收入为计提的自2020年06月25日本基金进入清算程序起至本基金清算款划出前一日银行活期存款、结算备付金及存出保证金的利息收入，由基金管理人以自有资金先行垫付，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。垫付资金及其孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

（2）投资收益为自2020年06月25日至2020年07月15日止清算期间的股票差价收入。

（3）公允价值变动损失为自2020年06月25日至2020年07月15日止清算期间的股票投资的公允价值变动损失。

（4）其他收入为2020年06月24日（基金最后运作日）本基金份额持有人提出申请并于2020年06月29日确认的基金赎回业务产生的赎回费收入。

（5）交易费用为卖出股票产生的费用。

（6）根据《关于国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级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》，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	附注	金额
一、最后运作日2020年06月24日基金净资产		22,325,971.20
加：清算期间净收益		1,266.25
清算期间从持有人权益转出	(1)	-410,586.85
二、2020年07月15日 基金净资产		21,916,650.60

注（1）本基金份额持有人于2020年06月24日（基金最后运作日）提交并于2020年06月29日确认的赎回申请，已于2020年06月30日支付基金赎回款。

资产处置及负债清偿后，于2020年07月15日本基金剩余财产为人民币21,916,650.60元，根据本基金的基金合同约定及《关于终止国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同及国投创业成长A份额和国投创业成长B份额终止上市有关事项的议案》，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06月25日至清算款划出日前一日的银行存款、清算备付金、结算保证金产生的利息亦属份额持有人所有。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) 《国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级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

国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金基金财产清算小组

2020年07月15日