
国投瑞银中证下游消费与服务产业指数
证券投资基金（LOF）
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：2022年02月16日

清算报告公告日：2022年02月18日

一、 重要提示

国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF) (以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2010]第1279号核准募集,于2010年12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《国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)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2021年12月1日至2022年1月11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《关于终止国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)基金合同并终止上市有关事项的议案》。本基金的最后运作日为2022年01月12日,于2022年01月13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2022年1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 | 国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金 (LOF) | |
| 基金主代码 | 161213 | |
| 交易代码 | 161213(前端) | 161215(后端) |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2010年12月16日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 12,816,203.96份 | |
| 投资目标 | 本基金通过被动的指数化投资管理,实现对中证下游消费 | |

| | |
|--------|---|
| | 与服务产业指数的有效跟踪。 |
| 投资策略 | <p>本基金为被动式指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。</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%×中证下游消费与服务产业指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后） |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 |
| 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[2010]第1279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2010年11月15日起至2010年12月10日向社会公开募集。本基金基金合同于2010年12月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为1,247,019,303.98份。自2010年12月16日至2022年01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》、《国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)基金合同》等有关规定，经本基金份额持有人大会2022年1月11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。本基金最后运作日为2022年01月12日，并从2022年01月13日起进入清算期。本基金清算期自2022年01月13日至2022年02月16日止。

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：国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2022年01月12日

单位：人民币元

| | 最后运作日 2022年01月12日 |
|---------------|----------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 2,474,964.97 |
| 结算备付金 | 25,023.57 |
| 存出保证金 | 1,586.12 |
| 交易性金融资产 | |
| 其中：股票投资 | |
| 应收证券清算款 | 27,775,558.79 |
| 应收申购款 | 1,958.97 |
| 其他资产 | 886.52 |
| 资产总计 | 30,279,978.94 |
| 负债： | |
| 应付赎回款 | 429,993.12 |
| 应付管理人报酬 | 6,959.44 |
| 应付托管费 | 1,507.87 |
| 其他负债 | 144,753.44 |
| 负债合计 | 583,213.87 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 12,816,203.96 |
| 未分配利润 | 16,880,561.11 |
| 所有者权益合计 | 29,696,765.07 |

| | |
|------------|----------------------|
| 负债和所有者权益总计 | 30,279,978.94 |
|------------|----------------------|

注：报告截止日 2022 年 1 月 12 日(最后运作日)，基金份额净值 2.317 元，基金份额总额 12,816,203.96 份。

五、 清算情况

自2022年01月13日至2022年02月16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

本基金2022年01月12日(基金最后运作日)的银行存款余额为人民币2,474,964.97元，其中银行存款本金为人民币2,474,478.85元，银行存款应计利息为人民币486.12元。

(2) 结算备付金

本基金2022年01月12日(基金最后运作日)的结算备付金余额为人民币25,023.57元，其中结算备付金本金人民币25,015.66元已于2022年02月08日全部划入本基金托管账户。本基金2022年1月12日(基金最后运作日)的结算备付金应收利息余额为7.91元，自2022年1月13日本基金进入清算程序起至2022年2月16日(本资产负债表批准报出日)止期间，共计产生利息30.51元，该款项将于清算结束后划入本基金托管账户。

(3) 存出保证金

本基金2022年01月12日(基金最后运作日)的存出保证金余额为人民币1,586.12元，其中本金为人民币1,584.73元，应计利息为人民币1.39元。本基金因交易结算规则，于2022年2月8日从本基金托管账户中划出6,040.85元至存出保证金账户，该款项将于3月第二个工作日调回托管账户，为加快清算速度，将由基金管理人先行垫付。本基金2022年1月12日(基金最后运作日)的存出保证金应收利息余额为1.39元，自2022年1月13日本基金进入清算程序起至2022年2月16日(本资产负债表批准报出日)止期间，共计产生存出保证金利息4.61元。截至2022年2月16日(本资产负债表批准报出日)，存出保证金余额为人民币7,631.58元，其中本金为人民币

7,625.58元，应计利息为人民币6.00元。

(4) 应收证券清算款

本基金2022年01月12日(基金最后运作日)的应收证券清算款余额为人民币27,775,558.79元，该款项已分别于2022年1月13日和2022年1月14日划入本基金托管账户。

(5) 应收申购款

本基金2022年1月12日(基金最后运作日)的应收申购款余额1,958.97元(均为应收申购款利息)。上述款项已于2022年2月7日划入本基金托管账户。

(6) 其他资产

本基金2022年1月12日(基金最后运作日)的其他资产余额886.52元(均为应收赎回款利息)。上述款项已于2022年2月7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2022年01月12日(基金最后运作日)的应付赎回款余额为人民币429,993.12元，该款项已于2022年01月13日支付。

(2) 应付管理人报酬

本基金2022年01月12日(基金最后运作日)的应付管理人报酬余额为人民币6,959.44元，该款项已于2022年2月8日支付。

(3) 应付托管费

本基金2022年01月12日(基金最后运作日)的应付托管费余额为人民币1,507.87元，该款项已于2022年2月8日支付。

(4) 其他负债

本基金于2022年1月12日(基金最后运作日)已确认的其他负债余额为144,753.44元。自2022年1月13日本基金进入清算程序起至2022年2月16日(本资产负债表批准报出日)止期间，其他负债中预提上市费5,000.00元、应付赎回费298.46元已于2022年1月13日支付，预提信息披露费50,000.00元已于2022年2月10日支付，应付交易费用40,128.81元已先后于2022年1月25日和2022年2月10日全部付清，预提审计费用47,000.00元和指数使用费2,326.17元尚未支付。

3、 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目 | 附注 | 2022年01月13日至2022年02月16日止清算期间 |
|-------------------|-----|------------------------------|
| 一、清算收益 | | 8,764.43 |
| 1、利息收入 | (1) | 9,192.81 |
| 2、投资收益(损失以“-”填列) | (2) | -1,564.35 |
| 3、其他收入(损失以“-”号填列) | (3) | 1,135.97 |
| 二、清算支出 | | 23.00 |
| 1、其他费用(收入以“-”号填列) | (4) | 23.00 |
| 三、清算净收益 | | 8,741.43 |

注(1) 利息收入为计提的自2022年1月13日本基金进入清算程序起至本基金本资产负债表批准报出日的银行存款、结算备付金、存出保证金及赎回款的利息收入，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结束后返还给基金管理人。

(2) 投资收益为自2022年1月13日至2022年2月16日止清算期间的股票红利税款。

(3) 其他收入为2022年1月12日(基金最后运作日)本基金的基金份额持有人提出赎回申请并于2022年1月13日确认的基金赎回业务产生的赎回费收入。

(4) 其他费用为清算期间支付的汇款费。

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2022年01月12日基金净资产 | | 29,696,765.07 |
| 加：清算期间净收益 | | 8,741.43 |
| 清算期间从持有人权益转出 | (1) | -2,237,314.23 |
| 二、2022年02月16日 基金净资产 | | 27,468,192.27 |

注(1) 本基金份额持有人于2022年01月12日(基金最后运作日)提交并于2022年01月13日确认的赎回申请，已于2022年01月14日支付基金赎回款。

资产处置及负债清偿后，于2022年2月16日(清算终止日)本基金剩余财产为人民币27,468,192.27元，根据本基金的基金合同约定及《关于终止国投瑞银中证下游消费与服务产

业指数证券投资基金（LOF）基金合同并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。

2022年02月16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结束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，在经会计师事务所出具清算审计报告，以及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）《国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金（LOF）清算审计报告》
- （2）《国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金（LOF）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

国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金（LOF）基金财产清算小组

2022年02月18日