

国都多策略混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：国都证券股份有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二三年七月七日

清算报告公告日：二〇二三年七月二十日

§ 1 重要提示及目录

§ 1.1 重要提示

国都多策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由国都证券股份有限公司（以下简称“基金管理人”）担任基金管理人，由兴业银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）担任基金托管人。本基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予国都多策略混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]1733号文）准予注册募集，自2018年5月25日成立并正式运作。

鉴于市场环境的变化，为保护基金份额持有人利益，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》的有关规定和《国都多策略混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）的约定，本基金管理人经与基金托管人协商一致，由基金管理人召集，以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，审议并表决通过了《关于终止国都多策略混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告详见2023年7月4日刊登在《中国证券报》、基金管理人网站（www.guodu.com）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上的《国都证券股份有限公司关于国都多策略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公告》。本基金管理人按照《基金合同》的约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。本基金的基金最后运作日定为2023年7月4日，并于2023年7月5日进入清算期。

本基金管理人国都证券股份有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所于2023年7月5日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，由上海市通力律师事务所对本基金清算事宜出具法律意见书。

§ 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
§1.1 重要提示.....	2
§1.2 目录.....	3
§2 基金产品概况	4
§3 基金运作情况	6
§4 财务会计报告	7
§4.1 资产负债表.....	7
§5 基金财产分配	9
§5.1 资产处置情况	9
§5.2 负债清偿情况	10
§5.3 清算期间的清算损益情况.....	10
§5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况.....	11
§5.5 基金财产清算报告的告知安排.....	11
§6 备查文件目录	12
§6.1 备查文件目录.....	12
§6.2 存放地点.....	12
§6.3 查阅方式.....	12

§ 2 基金产品概况

基金名称	国都多策略混合型证券投资基金
基金简称	国都多策略
基金主代码	005264
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年5月25日
最后运作日（2023年7月4日）基金份额总额	1,771,941.17份
投资目标	本基金将灵活运用多种投资策略，在严格控制风险并保证流动性的前提下，充分挖掘市场中潜在的投资机会，力争为基金份额持有人创造中长期稳健的投资回报。
投资策略	<p>本基金采用多种投资策略和交易手段进行大类资产配置和股票的行业配置，在预防出现单一策略可能失效的情况下，保证整体投资业绩的稳健持续性。</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金将综合运用定性和定量的分析方法，在对宏观经济进行深入研究的基础上，依据宏观经济周期所处阶段及变化趋势，结合估值水平、政策取向等因素，综合评估各大类资产的预期收益率和风险，合理确定本基金在股票、债券、权证、现金等大类资产之间的配置比例，以最大限度降低投资组合的风险、提高投资组合的收益。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金在深入分析企业基本面的基础上，建立成长策略、价值策略、再融资策略、动量策略、主题策略、事件驱动策略等多策略投资体系，并根据市场环境的变化进行灵活运用。其中，成长策略采用自下而上的分析方法，从多维度进行企业成长性分析，精选具有较高成长性的股票；价值策略通过定性和定量分析结合估值分析，精选出价值被低估的股票进行投资；再融资投资策略主要关注上市公司再融资过程中事件关联的投资机会；动量策略重在捕捉市场动量效应驱动的投资机会；主题策略通过经济发展和资本市场趋势变化的研究把握不同主题的投资机会；事件驱动策略通过捕捉特定事件对上市公司价值有显著影响的投资机会。本基金通过以上多种策略的综合运用，精选具有估值优势的个股建立投资组合，并根据阶段性的市场变化因素进行动态调整。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>债券投资主要用于提高非股票资产的收益率，基金管理人将坚持价值投资的理念，严格控制风险，追求合理的回报。本基金将通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策</p>

	<p>略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。</p> <p>本基金管理人密切关注通胀、利率、期限、流动性、税收等因素，实时确定各债券品种的公允价值。通过配置不同类别和期限的债券品种，达到债券组合的收益率目标。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货以对冲系统性风险为目的，达到套期保值目的。基金管理人动态调整股指期货合约持仓品种、持仓数量，与现货相匹配，控制风险，并驻留相对收益。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。</p> <p>6、权证投资策略</p> <p>本基金的权证投资以控制风险、平滑收益、锁定利润为主要目的。本基金通过对权证标的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑其的流动性，谨慎投资。</p> <p>7、可转债投资策略</p> <p>可转债不同于一般的企业债券，其投资人具有在一定条件下转股、回售的权利，因此其理论价值等于作为普通债券的基础价值加上可转债内含选择权的价值。本基金投资于可转债，主要目标是降低基金净值的下行风险，基金投资的可转债可以转股，以保留参与股票升值的收益潜力。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益风险水平的投资品种。
基金管理人	国都证券股份有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况概述

国都多策略混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会《关于准予国都多策略混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]1733 号文）准予注册募集，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于 2018 年 2 月 26 日至 2018 年 5 月 22 日期间向社会公开募集，基金合同于 2018 年 5 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 289,058,401.60 份（含募集期间利息结转的份额）。

自 2018 年 5 月 25 日至 2023 年 7 月 4 日期间，本基金按基金合同正常运作。

鉴于市场环境的变化，为保护基金份额持有人利益，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》的有关规定和《基金合同》的约定，本基金管理人经与基金托管人协商一致，由基金管理人召集，以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，审议并表决通过了《关于终止国都多策略混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本基金的基金最后运作日定为 2023 年 7 月 4 日，并于 2023 年 7 月 5 日进入清算期。

§ 4 财务报表

§ 4.1 资产负债表

基金最后运作日资产负债表

会计主体：国都多策略混合型证券投资基金

报告截止日：2023年7月4日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2023年7月4日
资产：	
银行存款	1,223,548.90
结算备付金	18,328.09
存出保证金	2,880.23
交易性金融资产	1,156,539.20
其中：股票投资	1,156,539.20
买入返售金融资产	
应收证券清算款	106,035.48
应收利息	
其他资产	
资产合计	2,507,331.90
负债和所有者权益：	
负债：	
短期借款	
交易性金融负债	
衍生金融负债	
卖出回购金融资产款	
应付证券清算款	44,424.51
应付赎回款	
应付管理人报酬	5,548.48
应付托管费	554.82
应付销售服务费	
应付交易费用	2,990.36
应付税费	1.48
应付利息	
应付利润	
其他负债（预提审计费）	2,534.50
负债合计	56,054.15
所有者权益：	
实收基金	1,771,941.17
未分配利润	679,336.58

所有者权益合计	2,451,277.75

注：本报告期的基金财务会计报告经信永中和会计师事务所审计，注册会计师颜凡清/齐晓瑞签字出具了 XYZH/2023BJAB2B0460 号标准无保留意见的审计报告。

§ 5 基金财产分配

本基金于 2023 年 7 月 5 日进入清算期。

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

自 2023 年 7 月 5 日至 2023 年 7 月 7 日止的清算期间，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。具体清算情况如下：

§ 5.1 资产处置情况

5.1.1. 本基金最后运作日银行存款科目余额为人民币 1,223,548.90 元，其中应收银行存款利息余额为人民币 169.62 元；清算结束日银行存款科目余额为人民币 2,416,533.76 元，其中应收银行存款利息余额为人民币 229.01 元。

5.1.2. 本基金最后运作日结算备付金科目余额为人民币 18,328.09 元，其中应收结算备付金利息余额为人民币 11.48 元；清算结束日结算备付金科目余额为人民币 18,330.55 元，其中应收结算备付金利息余额为人民币 13.94 元。

5.1.3. 本基金最后运作日存出保证金科目余额为人民币 2,880.23 元，其中应收存出保证金利息余额为人民币 1.30 元；清算结束日存出保证金科目余额为人民币 2,880.62 元，其中应收存出保证金利息余额为人民币 1.69 元。

5.1.4. 本基金最后运作日交易型金融资产科目为人民币 1,156,539.20 元，清算期内交易型金融资产均已变现，清算结束日无人民币余额。

5.1.5. 本基金最后运作日应收证券清算款科目为人民币 106,035.48 元，清算期内均已收到，存入银行存款账户中。

上述资产中银行存款、结算备付金、存出保证金至清算划款日前一日产生的后续利息，归基金持有人所有。清算划款日当日基金管理人以自有资金垫付结算备付金、存出保证金及未结息部分金额，划入托管账户。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。

§ 5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款科目无余额，于清算期间内，处置最后运作日投资人当日赎回申请，支付赎回款人民币 1,696.28 元，于清算结束日应付赎回款无余额。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬科目余额为人民币 5,548.48 元，于清算期间支付，于清算结束日应付管理人报酬科目无余额。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费科目余额为人民币 554.82 元，于清算期间支付，于清算结束日应付托管费科目无余额。

5.2.4 本基金最后运作日应付佣金科目余额为人民币 2,990.36 元，清算期内因处置剩余金融资产产生交易佣金人民币 1,054.45 元，均于清算期间支付共人民币 4,044.81 元，于清算结束日应付佣金科目无余额。

5.2.5 本基金最后运作日应付税费科目余额为人民币 1.48 元，于清算期间支付，于清算结束日应付税费科目无余额。

5.2.6 本基金最后运作日应付证券清算款 44,424.51 元，清算期内均已支付。

5.2.7 本基金最后运作日其他负债（预提审计费）为人民币 2,534.50 元，基金管理人考虑到本基金剩余资产较少，决定由管理人自行承担本基金审计相关费用，不再由基金资产承担，于清算结束期内预提费用反冲，清算结束日其他负债无余额。

§ 5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2023年7月5日至 2023年7月7日止（清算期间）
一、清算期间收益	
存款利息收入	59.39
债券利息收入	0.00
结算备付金、存出保证金利息收入	2.85
买入返售金融资产利息收入	0.00
投资收益	52,623.15
公允价值变动收益	-64,767.35
其他业务收入	0.00
二、清算期间费用	
管理人报酬	0.00
托管费	0.00
销售服务费	0.00
利息支出	0.00

其中：卖出回购金融资产支出	0.00
税金及附加	0.00
其他费用	-245.42
三、清算期间净收益	-11,836.54

注：1、此处的其他业务收入为赎回费收入。

2、其他费用包含预提审计费及交易费用。

§ 5.4 资产处置及负债清偿后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 2023 年 7 月 4 日基金净资产	2,451,277.75
加：清算期间净收益	-11,836.54
减：运作最后一日委托人赎回申请	1,696.28
二、清算结束日 2023 年 7 月 7 日基金净资产	2,437,744.93

资产处置及负债清偿后，本基金清算结束日 2023 年 7 月 7 日的剩余财产为人民币 2,437,744.93 元，清算结束日基金份额总额为 1,770,715.00 份。自清算结束日次日 2023 年 7 月 8 日起至清算款划出日前一日的产生的利息属份额持有人所有，由基金管理人以自有资金垫付并划入托管账户。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。

根据本基金的基金合同约定，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、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。后续由于清算支付过程中所产生的划款手续费由剩余资产承担。

§ 5.5 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金管理人审核、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，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

§ 6 备查文件

§ 6.1 备查文件目录

- 1、国都多策略混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 2、关于《国都多策略混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

§ 6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

§ 6.3 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，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人客服热线 400-818-8118。

国都多策略混合型证券投资基金基金财产清算小组

2023年7月7日