
国投瑞银安睿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：中国农业银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年01月08日

清算报告公告日：2024年01月10日

一、 重要提示

国投瑞银安睿混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]563号《关于准予国投瑞银安睿混合型证券投资基金注册的批复》注册募集,于2021年9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”),基金托管人为中国农业银行股份有限公司(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》、《国投瑞银安睿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50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,同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。”

截至2023年12月19日日终,本基金资产净值已连续50个工作日低于5000万元,触发了上述《基金合同》的终止情形。根据《基金合同》约定,本基金的最后运作日为2023年12月19日,自2023年12月20日起进入基金财产清算程序。

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2023年12月20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	国投瑞银安睿混合
基金主代码	011731
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年9月16日
运作终止日基金份额总额	539,702.10份

<p>投资目标</p>	<p>在严格控制风险的前提下，本基金通过股票与债券等资产的合理配置，力争基金资产的持续稳健增值</p>
<p>投资策略</p>	<p>本基金将采取主动的类别资产配置策略，注重风险与收益的平衡。本基金将精选具有较高投资价值的股票和债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。</p> <p>1、类别资产配置：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（包括A股、存托凭证和港股通标的股票等）、债券及货币市场工具等类别资产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>2、债券投资管理：本基金采取“自上而下”的债券分析方法，确定债券投资组合，并管理组合风险。</p> <p>3、股票投资管理：（1）行业配置策略：本基金管理人在进行行业配置时，将采用自上而下与自下而上相结合的方式确定行业权重。在投资组合管理过程中，基金管理人也将根据宏观经济形势以及各个行业的基本面特征对行业配置进行持续动态地调整。（2）优选个股策略：本基金构建股票组合的步骤是：根据定量与定性分析确定股票初选库；基于公司基本面全面考量、筛选优势企业，运用现金流贴现模型等估值方法，分析股票内在价值；结合风险管理，构建股票组合并对其进行动态调整。（3）存托凭证投资策略：本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。（4）港股通标的股票投资：本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制适度参与港股市场投资，以增强整体收益。</p> <p>4、可转换债券投资管理：本基金将利用期权定价模</p>

	<p>型等数量化方法对可转债的价值进行估算，选择价值低估的可转换债券进行投资。本基金投资于可转债及可交换债券的合计投资比例不得超过基金资产净值的 20%。</p> <p>5、可交换债券投资管理：本基金将结合对可交换债券的纯债部分价值以及对目标公司的股票价值的综合评估，选择具有较高投资价值的可交换债券进行投资。</p> <p>6、股指期货投资管理：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。</p> <p>7、资产支持证券投资管理：本基金将深入研究影响资产支持证券价值的多种因素，评估资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险，通过信用分析和流动性管理，辅以数量化模型分析，精选经风险调整后收益率较高的品种进行投资，力求获得长期稳定的投资收益。</p>	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中证港股通综合指数收益率×5%+中债综合指数收益率×75%	
风险收益特征	<p>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。</p> <p>本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。</p>	
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国投瑞银安睿混合 A	国投瑞银安睿混合 C
下属分级基金的交易代码	011731	011732

报告期末下属分级基金的份额总额	485,837.02 份	53,865.08 份
-----------------	--------------	-------------

三、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2021]563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2021年8月23日起至2021年9月14日向社会公开募集。本基金基金合同于2021年9月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为220,062,850.81份。自2021年9月16日至2023年12月19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》、《国投瑞银安睿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，截至2023年12月19日日终，本基金资产净值连续50个工作日低于5000万元，触发《基金合同》的终止情形，无需召开基金份额持有人大会，进入资产变现及清算程序。本基金最后运作日为2023年12月19日，并从2023年12月20日起进入清算期。本基金清算期自2023年12月20日至2024年01月8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：国投瑞银安睿混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月19日

单位：人民币元

	最后运作日 2023年12月19日
资产：	
银行存款	2,598,516.88
结算备付金	53,141.51
存出保证金	15,440.52
交易性金融资产	
其中：股票投资	

应收证券清算款	
应收申购款	
其他资产	2,485.39
资产总计	2,669,584.30
负债：	
应付赎回款	1,999,942.21
应付管理人报酬	5,438.69
应付托管费	906.44
应付销售服务费	395.50
应交税费	44.68
其他负债	158,096.26
负债合计	2,164,823.78
所有者权益：	
实收基金	539,702.10
未分配利润	-34,941.58
所有者权益合计	504,760.52
负债和所有者权益总计	2,669,584.30

注：报告截止日 2023 年 12 月 19 日（基金最后运作日），基金份额总额 539,702.10 份，其中 A 类基金份额净值 0.9363 元，基金份额 485,837.02 份；C 类基金份额净值 0.9260 元，基金份额 53,865.08 份。

五、 清算情况

自 2023 年 12 月 20 日至 2024 年 01 月 8 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2023年12月19日(基金最后运作日)的银行存款余额为2,598,516.88元,其中本金2,592,852.85元,应计利息5,664.03元。

(2) 结算备付金

本基金2023年12月19日(基金最后运作日)的结算备付金余额为53,141.51元,其中结算备付金本金52,754.79元,应计利息386.72元。因交易结算规则,结算备付金本金将于2024年2月第六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。应计利息386.72元已于2023年12月22日前划入本基金托管账户。自2023年12月20日本基金进入清算程序起至2024年1月8日(清算终止日)止期间,共计产生利息47.6元,其中4.76元已于2023年12月22日前划入本基金托管账户,剩余款项将于下次结息后划入本基金托管账户。

(3) 存出保证金

本基金2023年12月19日(基金最后运作日)的存出保证金余额为15,440.52元,其中本金15,371.79元已于2024年1月3日全部划入本基金托管账户,应计利息为68.73元已于2023年12月22日前划入本基金托管账户。自2023年12月20日本基金进入清算程序起至2024年1月8日(清算终止日)止期间,共计产生利息10.5元,其中1.40元已于2023年12月22日前划入本基金托管账户,剩余款项将于下次结息后划入本基金托管账户。

(4) 其他资产

本基金2023年12月19日(基金最后运作日)的其他资产余额2,485.39元(均为应收赎回款利息)。上述款项已于2023年12月21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2023年12月19日(基金最后运作日)的应付赎回款余额为1,999,942.21元,该款项已于2023年12月20日支付。

(2) 应付管理人报酬

本基金2023年12月19日(基金最后运作日)的应付管理人报酬余额为5,438.69元,该款项已于2024年1月3日支付。

(3) 应付托管费

本基金2023年12月19日(基金最后运作日)的应付托管费余额为906.44元,该款项已于2024年1月3日支付。

(4) 应付销售服务费

本基金2023年12月19日(基金最后运作日)的应付销售服务费余额为395.50元,该款项已于2024年1月3日支付。

(5) 应交税费

本基金2023年12月19日(基金最后运作日)的应交税费余额为44.68元,该款项将于清算结束后支付。

(6) 其他负债

本基金于2023年12月19日(基金最后运作日)已确认的其他负债余额为158,096.26元。自2023年12月20日本基金进入清算程序起至2024年1月8日(清算终止日)止期间,其他负债中预提中债账户维护费4,500.00元已于2023年12月20日支付,预提汇划费2,000.00元中470.69元已于2023年12月25日支付,剩余预提汇划费1,529.31元、应付交易费用23,596.26元、预提信息披露费80,000.00元、审计费用48,000.00元将于清算结束后支付。

3、 清算期间的清算损益情况

单位:人民币元

项目	附注	2023年12月20日至2024年1月8日止清算期间
一、清算收益		376.91
1、利息收入	(1)	376.91
2、投资收益(损失以“-”填列)		0.00
3、其他收入(损失以“-”号填列)		0.00
二、清算支出		0.00
1、其他费用(收入以“-”号填列)		0.00
三、清算净收益		376.91

注(1)利息收入为计提的自2023年12月20日本基金进入清算程序起至2024年1月8日(清算终止日)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。

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2023年12月19日基金净资产		504,760.52
加：清算期间净收益		376.91
清算期间从持有人权益转出		0.00
二、清算终止日2024年1月8日基金净资产		505,137.43

资产处置及负债清偿后，于2024年1月8日（清算终止日）本基金剩余财产为人民币505,137.43元，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（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。

2024年1月8日至清算款划出日前一日的银行存款、清算备付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）《国投瑞银安睿混合型证券投资基金基金清算审计报告》
- （2）《国投瑞银安睿混合型证券投资基金基金清算事宜之法律意见》

2、存放地点

中国广东省深圳市福田区福华一路119号安信金融大厦18楼

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

国投瑞银安睿混合型证券投资基金基金财产清算小组

2024年01月10日