
国投瑞银安泽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：中信银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年12月27日

清算报告公告日：2025年1月2日

一、 重要提示

国投瑞银安泽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]1053号文《关于准予国投瑞银安泽混合型证券投资基金注册的批复》注册，由国投瑞银基金管理有限公司作为基金管理人向社会公开发售募集，基金合同于2021年12月21日正式生效，首次设立募集规模（含利息转份额）为205,881,149.84份基金份额。

本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司，注册登记机构为国投瑞银基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

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》以及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，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2024年12月19日日终，本基金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2024年12月19日，自2024年12月20日起进入基金财产清算程序。

根据《关于国投瑞银安泽混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于2024年12月20日起进入清算期，基金管理人已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，故本基金清算起始日为2024年12月20日。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，上海市通力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	国投瑞银安泽混合型证券投资基金
基金简称	国投瑞银安泽混合
基金主代码	012019
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日	2021年12月21日
最后运作日基金份额总额	201,508.12份
投资目标	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。
投资策略	<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</p>

	目的，适度运用股指期货。 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。	
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	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。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。	
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国投瑞银安泽混合 A	国投瑞银安泽混合 C
下属分级基金的交易代码	012019	012020
报告期末下属分级基金的份额总额	15,000.46 份	186,507.66 份

三、 基金运作情况

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为 0-45%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；本基金投资于同业存单的比例不得超过基金资产净值的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购

款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：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%。

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》以及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，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。根据《关于国投瑞银安泽混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金最后运作日为 2024 年 12 月 19 日，从 2024 年 12 月 20 日起进入清算期。本次清算期间为 2024 年 12 月 20 日至 2024 年 12 月 27 日。

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：国投瑞银安泽混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 19 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2024 年 12 月 19 日
资产：	
货币资金	302,710.06
结算备付金	55.50
存出保证金	9,721.13
交易性金融资产	-
其中：基金投资	-
其中：债券投资	-
应收清算款	-
应收申购款	-

其他资产	2,537.59
资产总计	315,024.28
负债：	
应付赎回款	622.46
应付管理人报酬	117.92
应付托管费	19.64
应付销售服务费	18.48
应交税费	-
其他负债	97,203.81
负债合计	97,982.31
所有者权益：	
实收基金	201,508.12
未分配利润	15,533.85
所有者权益合计	217,041.97
负债和所有者权益总计	315,024.28

注：报告截止日 2024 年 12 月 19 日(基金最后运作日)，基金份额总额 201,508.12 份。其中 A 类基金份额净值 1.0749 元，基金份额 15,000.46 份，C 类基金份额净值 1.0773 元，基金份额 186,507.66 份。

五、 清算情况

自 2024 年 12 月 19 日至 2024 年 12 月 27 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：

(一) 资产处置情况

1、 银行存款

本基金最后运作日货币资金为人民币 302,710.06 元，其中银行存款本金人民币 301,067.70 元，银行存款应计利息人民币 1,642.36 元。基金管理人于清算结束后以自有资金垫付剩余银行存款应计利息款项。

2、 结算备付金

本基金最后运作日结算备付金为人民币 55.50 元，其中本金人民币 0 元，备付金应收利息人民币 55.50 元。于清算期间收到利息人民币 55.43 元且均已划至银行存款，冲回计提应计利息人民币 0.07 元。截止至清算结束日结算备付金无余

额。

3、存出保证金

本基金最后运作日存出保证金为人民币9,721.13元，其中本金人民币9,690.76元，应计利息人民币30.37元。于清算期间计提应计利息人民币3.52元，收到利息人民币31.22元且均已划出至银行存款，冲回计提应计利息人民币0.03元。截止至清算结束日存出保证金为人民币9,693.40元，其中本金人民币9,690.76元，应计利息人民币2.64元。基金管理人于清算结束后以自有资金垫付剩余存出保证金本金和应计利息款项。

4、其他资产

本基金最后运作日应收赎回款利息2,537.59元，该款项已于2024年12月20日划入本基金托管账户。截止清算结束日已无余额。

(二) 负债清偿情况

1、应付赎回款

本基金最后运作日应付赎回款为人民币622.46元。该款项已于2024年12月20日支付。

2、应付管理人报酬

本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币117.92元。截止清算结束日应付管理人报酬为人民币117.92元，上述款项于清算结束后支付。

3、应付托管费

本基金最后运作日应付托管费为人民币19.64元。截止清算结束日应付托管费为人民币19.64元，上述款项于清算结束后支付。

4、应付销售服务费

本基金最后运作日应付销售服务费为人民币18.48元。截止清算结束日应付销售服务费为人民币18.48元，上述款项于清算结束后支付。

5、其他负债

本基金最后运作日其他负债为人民币97,203.81元，其中预提清算审计费人民币5,000元，预提信息披露费人民币80,000元，预提账户维护费人民币1,500元，应付交易费用合计人民币10,703.81元。于清算期间支付应付交易费用人民币10,703.81元，支付账户维护费人民币1,500.00元，计提预提银行汇划费人民币

300.00元。截止至清算结束日其他负债为人民币85,300.00元，上述款项于清算结束日后支付。

(三) 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	附注	2024年12月20日至2024年12月27日止清算期间
一、清算收益		9.87
1、利息收入	(1)	9.87
二、清算支出		300
1、其他费用(收入以“-”号填列)	(2)	300
三、清算净收益		-290.13

注：(1) 利息收入为计提的自2024年12月20日本基金进入清算程序起至2024年12月27日(清算结束日)的银行活期存款利息收入、存出保证金的利息收入。

(2) 其他费用为本次清算预提银行汇划费300元。

(四) 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2024年12月19日基金净资产		217,041.97
加：清算期间净收益		-290.13
清算期间从持有人权益转出	(1)	-53.60
二、清算结束日2024年12月27日基金净资产		216,698.24

注：(1) 清算期间从持有人权益转出系本基金份额持有人于最后运作日2024年12月19日提交的赎回申请，已于2024年12月23日完成基金赎回款支付。

根据本基金基金合同的约定，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。

清算结束日次日至清算款划出日前一日的货币资金和存出保证金产生的利息归基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基

金管理人将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）供清盘分配使用，待结息日回款后再返还给基金管理人。

（五）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，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

（一）备查文件目录

- 1、《国投瑞银安泽混合型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《上海通力律师事务所关于〈国投瑞银安泽混合型证券投资基金清算报告〉的法律意见》

（二）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>、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

国投瑞银安泽混合型证券投资基金基金财产清算小组

2024年12月27日