
国投瑞银瑞宁灵活配置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：中国银行股份有限公司

清算报告出具日：2019年9月25日

清算报告公告日：2019年10月9日

一、 重要提示

国投瑞银瑞宁灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2016]1076号文注册募集,于2016年7月13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《国投瑞银瑞宁灵活配置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,提议终止《基金合同》。

本基金于2019年8月7日至2019年9月9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宁灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本基金的最后运作日为2019年9月10日,于2019年9月11日起进入清算期。

基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2019年9月11日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并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

| | |
|-------------------------|--------------------------|
| 基金名称 | 国投瑞银瑞宁灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 国投瑞银瑞宁混合 |
| 基金主代码 | 002831 |
| 交易代码 | 002831 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年7月13日 |
| 最后运作日(2019年9月10日)基金份额总额 | 6,440,693.67份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险的基础上,通过对不同类别资产的优化 |

| | |
|------|--|
| | 配置及组合精选，力求实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金的投资策略主要包括类别资产配置策略、股票投资管理策略、事件驱动策略、债券投资管理策略等。</p> <p>（一）类别资产配置</p> <p>本基金每三年为一个资产配置周期，其中，第一个资产配置周期为自《基金合同》生效日起至三个公历年后对应日止的期间，三个公历年后对应日的下一工作日起本基金即进入下一资产配置周期，以此类推。在遵守资产配置周期内的股票仓位控制安排的前提下，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、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>本基金采用多因素分析框架，从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、市场投资价值、资金供求因素、证券市场运行内在动量等方面，采取定量与定性相结合的分析方法，对证券市场投资机会与风险进行综合研判。</p> <p>（二）股票投资管理</p> <p>股票投资管理包括行业配置策略和优选个股策略。</p> <p>（三）事件驱动策略</p> <p>本基金将持续关注事件驱动投资机会，基金管理人重点关注的事件包括资产重组、资产注入、公司兼并收购、公司股权变动、公司再融资、上市公司管理层变动、公司股权激励计划、新产品研发与上市等等。</p> <p>（四）债券投资管理</p> <p>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>（五）衍生品投资策略</p> <p>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、国债期货</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>等金融衍生品。</p> <p>(六) 对于中小企业私募债券，本基金将重点关注发行人财务状况、个券增信措施等因素，以及对基金资产流动性的影响，在充分考虑信用风险、流动性风险的基础上，进行投资决策。</p> <p>(七) 对于资产支持证券，其定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，属于中高风险、中高收益的基金品种，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。 |
| 基金管理人 | 国投瑞银基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |

三、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2016]1076号文注册募集，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定向社会公开募集。本基金基金合同于2016年7月13日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为308,033,404.35份。自2016年7月13日至2019年9月10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》、《国投瑞银瑞宁灵活配置混合型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于2019年9月9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2019年9月11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：国投瑞银瑞宁灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019年9月10日

单位：人民币元

| | 最后运作日 2019年9月10日 |
|---------------|---------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 6,581,342.64 |
| 结算备付金 | - |
| 存出保证金 | 3,001.34 |
| 交易性金融资产 | - |
| 其中：股票投资 | - |
| 债券投资 | - |
| 应收利息 | 9,034.91 |
| 应收证券清算款 | - |
| 资产总计 | 6,593,378.89 |
| 负债： | |
| 应付赎回款 | - |
| 应付管理人报酬 | 2,983.23 |
| 应付托管费 | 298.33 |
| 应付交易费用 | - |
| 其他负债 | - |
| 负债合计 | 3,281.56 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 6,440,693.67 |
| 未分配利润 | 149,403.66 |
| 所有者权益合计 | 6,590,097.33 |
| 负债和所有者权益总计 | 6,593,378.89 |

注：报告截止日2019年9月10日(基金最后运作日)，基金份额净值1.023元，基金份额总额6,440,693.67份。

五、 清算情况

自2019年9月11日至2019年9月25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) 本基金最后运作日存出保证金人民币3,001.34元，截至2019年9月25日存出保证金余额为人民币3,001.34元，该款项将于清算结束后划入本基金托管账户。

(2) 本基金最后运作日应收利息人民币9,034.91元，其中包括应收银行存款利息人民币8,684.97元、应收存出保证金利息人民币12.75元及应收赎回款利息人民币337.19元。其中，应收赎回款利息人民币337.19元，已于清算期间收回并划入本基金托管账户。

截至2019年9月25日应收利息余额为人民币516.72元，其中应收银行存款利息人民币516.16元及应收存出保证金利息人民币0.56元，该款项将于结息后划入本基金托管账户。

2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币2,983.23元，该款项已于2019年9月12日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币298.33元，该款项已于2019年9月12日支付。

3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目 | 自2019年9月11日至 2019年9月25日止清算期间 |
|------------|---------------------------------|
| 一、清算收益 | |
| 1、利息收入（注1） | 1,812.84 |
| 2、投资收益 | - |
| 3、公允价值变动损益 | - |
| 4、其他收入（注2） | 471.44 |
| 清算收益小计 | 2,284.28 |
| 二、清算支出 | |
| 1、交易费用 | - |
| 2、清算费用（注3） | - |
| 清算支出小计 | - |

| | |
|---------|----------|
| 三、清算净收益 | 2,284.28 |
|---------|----------|

注1：利息收入系计提的自2019年9月11日起至2019年9月25日止清算期间的银行存款利息及赎回款利息。

注2：其他收入系最后运作日基金份额持有人发生赎回业务产生的赎回费收入。

注3：根据《关于终止国投瑞银瑞宁灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项议案的说明》，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 | 金额 |
|------------------------|--------------|
| 一、最后运作日2019年9月10日基金净资产 | 6,590,097.33 |
| 加：清算期间净收益 | 2,284.28 |
| 清算期间从持有人权益转出（注1） | -131,991.36 |
| 二、2019年9月25日基金净资产 | 6,460,390.25 |

注1：本基金份额持有人于最后运作日（2019年9月10日）提交的赎回申请，已于2019年9月12日支付基金赎回款。

根据本基金的《基金合同》及《关于国投瑞银瑞宁灵活配置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的公告》，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（如有）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。

因清算款划出日不能确定，暂不能准确预估清算结束日至清算款划出日前一日银行存款产生的利息，该期间利息亦属全体份额持有人所有，将于划出清算款时一并向基金份额持有人分配。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前以自有资金先行垫付相关应收利息（该金额可能与实际结息金额存在略微差异）及存出保证金款项（如有）。基金管理人垫付的资金以及垫付资金产生的利息（以实际结息金额为准）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) 《国投瑞银瑞宁灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《国投瑞银瑞宁灵活配置混合型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

国投瑞银瑞宁灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2019年9月25日