

---

# 国投瑞银研究精选股票型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年7月12日

清算报告公告日：2024年7月16日

## 一、重要提示

国投瑞银研究精选股票型证券投资基金(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[2015]1118号《关于准予国投瑞银研究精选股票型证券投资基金注册的批复》注册,于2017年12月1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《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》、《国投瑞银研究精选股票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60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。”

根据市场环境变化及基金运作情况,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《基金合同》的有关规定,本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会,投票时间为自2024年5月21日至2024年6月20日上午10:00止,会议审议并表决通过了《关于终止国投瑞银研究精选股票型证券投资基金基金合同有关事项的议案》(以下简称“本次会议议案”)。根据本次会议议案及《关于终止国投瑞银研究精选股票型证券投资基金基金合同有关事项的议案的说明》,本基金自2024年6月22日起进入基金财产清算程序。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)和上海市通力律师事务所于2024年6月22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	国投瑞银研究精选股票型证券投资基金
基金简称	国投瑞银研究精选股票
基金主代码	001520

基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月1日
最后运作日基金份额总额	40,205,678.36份
投资目标	通过深入系统的研究精选，挖掘股票市场投资机会，力争基金资产的持续稳健增值。
投资策略	<p>本基金充分发挥基金管理人的研究优势，依据行业研究员模拟组合以及相应的公司行业研究成果，结合“自下而上”的精选个股策略与“自上而下”的资产配置和行业配置策略，在注重风险与收益平衡的前提下，力争基金资产的持续稳健增值。</p> <p>（一）类别资产配置</p> <p>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>（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>1、行业配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、优选个股策略</p> <p>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</p>

	<p>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。</p> <p>（三）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。债券投资策略主要包括：久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略和个券选择策略。</p> <p>（四）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，适度运用股指期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中风险程度较高的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、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[2015]1118号《关于准予国投瑞银研究精选股票型证券投资基金注册的批复》注册募集，由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定于2017年11月17日起至2017年11月28日向社会公开募集。《基金合同》于2017年12月1日正式生效，《基金合同》生效日的基金份额总数为225,391,980.74份。自2017年12月1日至2024年6月21日期间，本基金正常运作。

根据市场环境变化及基金运作情况，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》、《关于终止国投瑞银研究精选股票型证券投资基金基金合同

有关事项的议案》、《关于终止国投瑞银研究精选股票型证券投资基金基金合同有关事项的议案的说明》和本基金基金合同的有关规定，本基金进入基金资产清算程序。本基金最后运作日为2024年6月21日，并从2024年6月22日起进入清算期。本基金清算期自2024年6月22日至2024年7月12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：国投瑞银研究精选股票型证券投资基金

报告截止日：2024年6月21日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2024年6月21日
<b>资产：</b>	
货币资金	33,134,023.67
结算备付金	72,541.79
存出保证金	15,527.45
交易性金融资产	
其中：基金投资	
其中：债券投资	
应收清算款	2,540,349.92
应收申购款	
其他资产	1,163.99
<b>资产总计</b>	<b>35,763,606.82</b>
<b>负债：</b>	
应付赎回款	
应付管理人报酬	25,867.59
应付托管费	4,311.28

应付销售服务费	
应交税费	
其他负债	109,952.54
负债合计	<b>140,131.41</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	40,205,678.36
未分配利润	-4,582,202.95
所有者权益合计	<b>35,623,475.41</b>
负债和所有者权益总计	<b>35,763,606.82</b>

注：报告截止日 2024 年 6 月 21 日（基金最后运作日），基金份额总额 40,205,678.36 份，基金份额净值 0.886 元。

## 五、 清算情况

自2024年6月22日至2024年7月12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2024年6月21日（基金最后运作日）的银行存款余额为33,134,023.67元，其中本金33,134,023.67元，无应计利息。

#### 2、结算备付金

本基金于2024年6月21日（基金最后运作日）的结算备付金余额为72,541.79元，其中结算备付金本金72,541.79元，无应计利息。于清算期间计提应计利息61.46元，从结算备付金划出至银行存款人民币38,981.77元。截止至清算结束日结算备付金为33,621.48元，其中本金33,560.02元，应计利息61.46元。剩余结算备付金本金及应计利息款项于清算结束日后以基金管理人自有资金垫付。

#### 3、存出保证金

本基金于2024年6月21日（基金最后运作日）的存出保证金余额为15,527.45元，其中本金

15,527.45元，无应计利息。于清算期间计提应计利息7.70元，从存出保证金划出至银行存款15,527.45元。截止至清算结束日存出保证金为7.70元，其中无本金，应计利息7.70元。剩余存出保证金应计利息款项于清算结束后以基金管理人自有资金垫付。

#### 4、应收清算款

本基金2024年6月21日(基金最后运作日)的应收清算款余额2,540,349.92元(均为清算资金往来以及股息红利税)。于清算期间股息红利税形成的应付清算款为4,451.50元，上述款项已于2024年6月25日前(含当日)分别划入和划出本基金托管账户。

#### 5、其他资产

本基金2024年6月21日(基金最后运作日)的其他资产余额1,163.99元(均为应收赎回款利息)。于清算期间计提应收赎回款利息人民币1.11元，上述款项已于2024年6月26日划入本基金托管账户。

### (二) 负债清偿情况

#### 1、应付管理人报酬

本基金2024年6月21日(基金最后运作日)的应付管理人报酬余额为25,867.59元，该款项已于2024年7月3日支付。

#### 2、应付托管费

本基金2024年6月21日(基金最后运作日)的应付托管费余额为4,311.28元，该款项已于2024年7月3日支付。

#### 3、其他负债

本基金于2024年6月21日(基金最后运作日)已确认的其他负债余额为109,952.54元，其中应付交易费用74,101.38元、预提信息披露费23,633.53元、预提审计费用11,817.63元、预计汇划费400.00元。截至2024年7月12日(清算终止日)，预提汇划费400.00元已于2024年7月3日支付17.00元。以上费用将于清算结束后支付。

### (三) 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	附注	2024年6月22日 至2024年7月12日止 清算期间
一、清算收益		2,861.48

1、利息收入	(1)	7,270.34
2、投资收益(损失以“-”填列)	(2)	-4,451.50
3、公允价值变动损益(损失以“-”号填列)		0.00
4、其他收入(损失以“-”号填列)	(3)	42.64
<b>二、清算支出</b>		<b>0.00</b>
1、其他费用(收入以“-”号填列)		0.00
<b>三、清算净收益</b>		<b>2,861.48</b>

注：(1) 利息收入为计提的自2024年6月22日本基金进入清算程序起至2024年7月12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终止日后返还给基金管理人。

(2) 投资收益为自2024年6月22日本基金进入清算程序起至2024年7月12日(清算终止日)支付的股息红利税4,451.50元。

(3) 其他收入为自2024年6月22日本基金进入清算程序起至2024年7月12日(清算终止日)的赎回费收入。

#### (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
<b>一、最后运作日2024年6月21日基金净资产</b>		<b>35,623,475.41</b>
加：清算期间净收益		2,861.48
清算期间从持有人权益转出		-55,528.49
<b>二、清算终止日2024年7月12日基金净资产</b>		<b>35,570,808.40</b>

资产处置及负债清偿后，2024年7月12日(清算终止日)本基金剩余财产为人民币35,570,808.40元，根据《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7月13日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金产生的利息亦属基金份额持有人所有。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。

---

（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、《国投瑞银研究精选股票型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《上海市通力律师事务所关于〈国投瑞银研究精选股票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

国投瑞银研究精选股票型证券投资基金基金财产清算小组

2024年7月16日