

---

# 国投瑞银新回报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：招商银行股份有限公司

清算报告出具日：2019年10月8日

清算报告公告日：2019年10月16日

## 一、 重要提示

国投瑞银新回报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[2015]286号文注册募集,于2015年3月20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”),基金托管人为招商银行股份有限公司(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《国投瑞银新回报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19日至2019年9月18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《关于终止国投瑞银新回报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19日,于2019年9月20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20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	国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国投瑞银新回报混合
基金主代码	001119
交易代码	001119
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月20日
最后运作日(2019年9月19日)	
基金份额总额	18,201,944.35份
投资目标	在严格控制风险的基础上,通过对不同资产类别

	<p>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。</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</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>2、股票投资管理</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>本基金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。</p> <p>3、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>4、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、国债期货等金融衍生品。</p>

业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%
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	招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]286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2015年3月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为2,000,475,963.93份。自2015年3月20日至2019年9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》、《国投瑞银新回报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18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20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：国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019年9月19日

单位：人民币元

	最后运作日 2019年9月19日
<b>资产：</b>	
银行存款	18,057,047.45
结算备付金	428,636.36

存出保证金	6,869.69
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
债券投资	-
应收利息	39,614.67
应收证券清算款	-
资产总计	18,532,168.17
<b>负 债：</b>	
应付赎回款	59,041.42
应付管理人报酬	37,505.76
应付托管费	6,250.98
应付交易费用	-
应交税费	307.34
其他负债	2,094.87
负债合计	105,200.37
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	18,201,944.35
未分配利润	225,023.45
所有者权益合计	18,426,967.80
负债和所有者权益总计	18,532,168.17

注：报告截止日2019年9月19日（基金最后运作日），基金份额净值1.012元，基金份额总额18,201,944.35份。

## 五、 清算情况

自2019年9月20日至2019年10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) 本基金最后运作日结算备付金人民币428,636.36元。截至2019年10月8日结算备付金

人民币428,636.36元，该款项将于清算结束后划入本基金托管账户。

(2) 本基金最后运作日存出保证金人民币6,869.69元。截至2019年10月8日存出保证金人民币6,869.69元，该款项将于清算结束后划入本基金托管账户。

(3) 本基金最后运作日应收利息人民币39,614.67元，其中包括应收银行存款利息人民币35,723.64元、应收结算备付金利息人民币991.36元、应收交易保证金利息人民币49.10元、应收申购款利息人民币1,799.94元以及应收赎回款利息人民币1,050.63元，已于清算期间收回并划入本基金托管账户。

截至2019年10月8日，应收利息余额为人民币5,128.82元，其中应收银行存款利息人民币4,776.02元、应收结算备付金利息人民币347.22元以及应收交易保证金利息人民币5.58元，将于清算结束后划入本基金托管户。

## 2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币59,041.42元，该款项已于2019年9月20日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币37,505.76元，该款项已于2019年9月20日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币6,250.98元，该款项已于2019年9月20日支付。

(4) 本基金最后运作日应交税费为人民币307.34元，该款项已于2019年9月20日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币2,094.87元，其中包括应付赎回费94.87元，已于2019年9月20日支付；以及计提的应付银行划款手续费2,000.00元，该款项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	自2019年9月20日至 2019年10月8日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	5,616.58
2、其他收入（注2）	2.02
清算收益小计	5,618.60

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	5,618.60

注1：利息收入系计提的自2019年9月20日起至2019年10月8日止清算期间的银行存款利息、交易保证金利息、赎回款利息及结算备付金利息。

注2：其他收入系最后运作日基金份额持有人的赎回业务产生的赎回费收入。

注3：根据《关于终止国投瑞银新回报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》，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。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、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2019年9月19日基金净资产	18,426,967.80
加：清算期间净收益	5,618.60
清算期间从持有人权益转出（注1）	-5,317,262.87
二、2019年10月8日基金净资产	13,115,323.53

注1：本基金份额持有人于最后运作日（2019年9月19日）提交的赎回申请，已于2019年9月23日支付基金赎回款。

根据本基金的《基金合同》及《关于终止国投瑞银新回报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》，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。

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）、结算备付金（

---

如有)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)《国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
- (2)《上海源泰律师事务所关于国投瑞银新回报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

国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组