

---

# 国投瑞银品牌优势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：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2020年7月31日

清算报告公告日：2020年8月5日

## 一、 重要提示

国投瑞银品牌优势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[2018]624号文核准募集,于2018年11月2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》、《国投瑞银品牌优势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,《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,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。根据《关于国投瑞银品牌优势灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算及基金合同终止的公告》及《基金合同》,本基金最后运作日为2020年7月22日,于2020年7月23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2020年7月23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	国投瑞银品牌优势灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国投瑞银品牌优势混合
基金主代码	005899
交易代码	005899
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年11月2日
最后运作日(2020年7月22日)基金份额总额	1,985,923.58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

	<p>等资产的合理配置，并精选品牌优势主题的相关上市公司股票进行投资，力争基金资产的持续稳健增值。</p>
<p>投资策略</p>	<p>本基金的投资策略主要包括类别资产配置策略、股票投资管理策略和债券投资管理策略等。</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（包括A股和港股通标的股票）、债券及货币市场工具等各资产类别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>1、本基金坚持价值投资的思路，采用自上而下和自下而上相结合的方式精选具有品牌优势的个股。具体而言，本基金重点关注具有品牌优势的企业，该类企业具有同业公司较难突破的核心竞争力或较高的市场进入壁垒。</p> <p>2、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>（三）权证投资管理</p> <p>1、考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素，估计权证合理价值。</p> <p>2、根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即“估值差价(Value Price)”以及权证合理价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理价值考量，决策买入、</p>

	<p>持有或沽出权证。</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）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>（六）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。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，以数量化模型确定其内在价值。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合指数收益率×40%。
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[2018]624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2018年9月26日至2018年10月30日向社会公开募集。本基金基金合同于2018年11月2日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为279,802,160.71份。自2018年11月2日至2020年7月22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》、《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，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。截至 2020 年 7 月 22 日日终，本基金的基金资产净值已连续 60 个工作日低于 5000 万元，触发了上述基金合同终止的情形，基金合同自动终止，基金管理人已就该事项于 2020 年 7 月 23 日刊登了《关于国投瑞银品牌优势灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算及基金合同终止的公告》。本基金从 2020 年 7 月 23 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：国投瑞银品牌优势灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 7 月 22 日

单位：人民币元

	最后运作日 2020 年 7 月 22 日
<b>资产：</b>	
银行存款	4,396,995.47
结算备付金	29,667.46
存出保证金	19,250.29
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
债券投资	-
应收利息	1,624.87
应收证券清算款	-
资产总计	4,447,538.09
<b>负债：</b>	
应付赎回款	1,289,441.59
应付管理人报酬	5,220.53
应付托管费	870.08
应付交易费用	-
应交税费	-
其他负债	60,122.11
负债合计	1,355,654.31
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	1,985,923.58
未分配利润	1,105,960.20
所有者权益合计	3,091,883.78
负债和所有者权益总计	4,447,538.09

---

注:报告截止日 2020 年 7 月 22 日(基金最后运作日),基金份额净值 1.5569 元,基金份额总额 1,985,923.58 份。

## 五、 清算情况

自2020年7月23日至2020年7月31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为人民币29,667.46元,截至2020年7月31日结算备付金为人民币29,667.46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19,250.29元,截至2020年7月31日存出保证金为人民币19,250.29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1,624.87元,包括应收银行存款利息人民币1,568.55元、应收结算备付金利息人民币29.46元及应收存出保证金利息人民币26.86元。

截至2020年7月31日应收利息人民币1,920.44元,其中包括应收银行存款利息人民币1,844.32元、应收结算备付金利息人民币41.43元、应收交易保证金利息人民币34.69元,以上款项将于清算结束后划入本基金托管账户。

(4) 本基金最后运作日其他应收款人民币0.00元。

截至2020年7月31日其他应收款人民币11.00元,该款项为清算期间划付相关应付款项产生的由管理人承担的汇划费,该款项将于清算结束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赎回款为人民币1,289,441.59元,该款项已于2020年7月23日支付42,506.24元,2020年7月24日支付822,172.55元,2020年7月27日支付424,762.80元。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币5,220.53元,该款项已于2020年7月24日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币870.08元,该款项已于2020年7月24日支

付。

- (4) 本基金最后运作日其他负债为人民币60,122.11元，包括预提信息披露费人民币60,000.21元，应付赎回费及应付转换费合计人民币121.90元。其中信息披露费已于2020年7月24日支付，应付赎回费及应付转换费已分别于2020年7月23日支付7.70元，2020年7月24日支付102.23元，2020年7月27日支付11.97元。截至2020年7月31日，其他负债余额为人民币0.00元。

### 3、 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2020年7月23日至 2020年7月31日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	295.57
2、投资收益	-
3、公允价值变动损益	-
4、其他收入（注2）	1,130.25
清算收益小计	1,425.82
二、清算支出	
1、交易费用	-
2、税金及附加	-
3、清算费用（注3）	-
清算支出小计	-
三、清算净收益	1,425.82

注1：利息收入系计提的自2020年7月23日起至2020年7月31日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息。

注2：其他收入系最后运作日基金份额持有人发生赎回及转出业务产生的赎回费和转换费收入。

注3：根据《关于国投瑞银品牌优势灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算及基金合同终止的公告》，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2020年7月22日基金净资产	3,091,883.78
加：清算期间净收益	1,425.82

清算期间从持有人权益转出（注1）	-965,788.52
二、2020年7月31日基金净资产	2,127,521.08

注1：本基金份额持有人于最后运作日（2020年7月22日）提交的赎回和转换申请，已分别于2020年7月24日和7月28日支付基金转换款和赎回款。

根据本基金的《基金合同》及《关于国投瑞银品牌优势灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算及基金合同终止的公告》，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。

清算结束日至清算款划出日前一日的银行存款、清算备付金、结算保证金产生的利息亦属份额持有人所有，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）《国投瑞银品牌优势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品牌优势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

国投瑞银品牌优势灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2020年8月5日