

国投瑞银兴顺3个月持有期混合型 基金中基金(FOF)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:上海浦东发展银行股份有限公司
清算报告出具日:2024年6月13日
清算报告公告日:2024年6月17日

一、重要提示

国投瑞银兴顺3个月持有期混合型基金中基金(FOF)(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[2022]864号《关于准予国投瑞银兴顺3个月持有期混合型基金中基金(FOF)注册的批复》核准,于2023年1月17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”),基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(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》、《国投瑞银兴顺3个月持有期混合型基金中基金(FOF)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50个工作日出现前述情形的,《基金合同》将终止并进入基金财产清算程序,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5月29日,本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5月29日,自2024年5月30日起进入基金财产清算程序。

基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2024年5月30日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所(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	国投瑞银兴顺3个月持有期混合型基金中基金(FOF)	
基金简称	国投瑞银兴顺3个月持有期混合(FOF)	
基金代码	015759	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年1月17日	
最后运作日基金份额总额	5,015,223.58份	
投资目标	在严格控制风险的前提下,本基金通过定量与定性相结合的方法进行资产配置和基金精选,力求实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	1.资产配置策略:本基金根据各类资产的估值趋势和预期收益风险的比较,对各类资产的配置比例进行动态调整,以期在控制风险的前提下实现收益最大化。 2.基金投资策略:本基金精选优质、本基金注重选择与本基金资产配置目标相匹配的被动指数(含增强)和/或主动管理基金,综合考虑基金管理人、基金经理、基金规模、基金业绩、基金流动性、基金费用、交易便利以及基金管理人在资产配置上的综合表现,选择适合的指数基金、主动管理基金、货币、债券、股票基金等基金品种,构建投资组合,并定期跟踪评估基金业绩,以评估基金公司的投研团队、业绩稳定性与持续性。其次,管理人将通过基金基金的能力优势,精选表现出相关能力优势的综合能力优势的基金进行投资,帮助基金投资者提高投资收益的能力,实现长期增值。最后,在整体基金选择方面,本基金基于基金风险控制、投资风格、基金规模、交易费用等因素的综合考量,力求寻找体现基金投资理念、业绩稳定、基金规模、交易费用合理的基金。 3.其他资产投资策略:本基金的其他资产投资策略主要采用“自下而上”选股策略,辅以行业分析进行组合优化。 (1)行业投资策略: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和判断,进行行业配置。 (2)个股选择策略:本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制参与港股市场投资,以增强整体收益。 (3)风险控制策略:本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制参与港股市场投资,以增强整体收益。 (4)债券投资策略:本基金将根据需要适度进行债券投资,在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性。本基金将主要投资于信用评级高、流动性好、收益率合理的债券品种。 (5)资产支持证券:资产支持证券定价受市场利率、发行条件、标的资产构成及质量、提前偿还率等多种因素影响,本基金将在充分评估和合理定价的基础上,审慎投资预期风险收益合理的品种。 4.风险控制策略:本基金将采用多种风险评估与控制措施,对投资组合进行事前和事后的风险评估、监测与管理。	
业绩比较基准	中证800指数收益率*25%+中债综合指数收益率*70%+银行活期存款利率(税后)*5%	
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金,其预期风险和预期收益高于债券型基金、货币型基金和货币型基金中基金,低于股票型基金和股票型基金中基金。本基金面临股票价格波动的风险、利率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	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分拆基金的基金简称	国投瑞银兴顺3个月持有期混合(FOF)A	国投瑞银兴顺3个月持有期混合(FOF)C
下属分拆基金的交易代码	015759	015760
最后运作日下属分拆基金的份额总额	2,726,329.13份	2,288,894.45份

三、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2022]864号《关于准予国投瑞银兴顺3个月持有期混合型基金中基金(FOF)注册的批复》核准募集,由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定于2022年10月20日起至

2023年1月13日向社会公开募集,《基金合同》于2023年1月17日正式生效,《基金合同》生效日的基金份额总数为201,621,562.83份。自2023年1月17日至2024年5月29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,截至2024年5月29日,本基金资产净值连续50个工作日低于5000万元,触发《基金合同》的终止情形,无需召开基金份额持有人大会,进入资产变现及清算程序。本基金最后运作日为2024年5月29日,并从2024年5月30日起进入清算期。本基金清算期自2024年5月30日至2024年6月13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:国投瑞银兴顺3个月持有期混合型基金中基金(FOF)

报告截止日:2024年5月29日(基金最后运作日)

单位:人民币元

	最后运作日 2024年5月29日
资产:	
货币资金	2,387,437.71
结算备付金	
存出保证金	
交易性金融资产	4,424,714.29
其中:基金投资	4,323,307.54
其中:债券投资	101,406.85
应收清算款	896,132.89
应收申购款	
其他资产	367.88
资产总计	7,648,632.17
负债:	
应付赎回款	2,693,725.71
应付管理人报酬	4,698.78
应付托管费	907.43
应付销售服务费	2,332.47
应交税费	1.27
其他负债	36,991.50
负债合计	2,738,657.76
所有者权益:	
实收基金	5,015,223.58
未分配利润	-105,229.17
所有者权益合计	4,909,994.41
负债和所有者权益总计	7,648,632.17

注:报告截止日2024年5月29日(基金最后运作日),基金份额总额5,015,223.58份,其中A类基金份额净值0.9815元,基金份额2,726,329.13份;C类基金份额净值0.9760元,基金份额2,288,894.45份。

五、清算情况

自2024年5月30日至2024年6月13日的清算期间,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. 货币资金

本基金2024年5月29日(基金最后运作日)的银行存款余额为1,365,728.76元,其中本金1,365,021.45元,应计利息707.31元。

本基金2024年5月29日(基金最后运作日)的券商备付金余额为1,021,708.95元,其中券商备付金本金1,021,153.07元,应计利息555.88元。券商备付金本金1,021,153.07元及自2024年5月30日本基金进入清算程序起至2024年5月31日期间交易性金融资产变现所得609,589.25元已于2024年6月3日划入本基金托管账户;应计券商备付金利息555.88元及自2024年5月30日本基金进入清算程序起至2024年6月3日券商备付金本金划出期间计提的应计利息71.91元已于2024年6月4日划入本基金托管账户。

2. 交易性金融资产

本基金于2024年5月29日(基金最后运作日)持有的交易性金融资产为4,424,714.29元,其中债券投资101,406.85元,基金投资4,323,307.54元(场内基金投资:515,642.70元,场外基金投资3,807,664.84元)。债券投资明细如下:

债券代码	债券简称	最后运作日估值单价	数量(单位:张)	最后运作日成本总额	最后运作日应计利息	最后运作日估值总额
019799	23国债16	101.41	1,000	99,597.45	1,396.85	101,406.85

以上债券投资已于2024年5月30日处置变现,变现金额为101,408.27元,该款项于处置当日划转至券

商备付金账户后于2024年6月3日划入本基金托管账户。

场内基金投资明细如下：

基金代码	基金名称	最后运作日估值单价	数量(单位:份)	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额
513050	华安国际龙头(DAX)ETF(QDII)	1.4020	67,100	93,818.17	94,074.20
513080	华安法国CAC40ETF(QDII)	1.6650	56,600	93,099.77	94,239.00
159632	华安纳斯达克100ETF(QDII)	1.5700	95,200	145,485.18	149,464.00
159635	华安标普500ETF(QDII)	1.4150	125,700	175,075.99	177,868.50

以上场内基金投资中华夏标普500ETF(QDII)、华安法国CAC40ETF(QDII)、华安国际龙头(DAX)ETF(QDII)已于2024年5月30日变现,实际变现金额为361,959.63元。华安纳斯达克100ETF(QDII)已于2024年5月31日变现,实际变现金额为146,221.35元。上述款项均于处置当日划转至商备付金账户后于2024年6月3日划入本基金托管账户。

场外基金投资明细如下：

基金代码	基金名称	最后运作日估值单价	数量(单位:份)	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额
000053	易方达信用债C	1.1292	546,730.38	617,860.00	617,367.95
000070	国投瑞银中高等债C	1.1430	666,172.04	747,030.12	761,454.64
000385	景顺长城景颐双利A	1.6640	383,828.65	606,449.28	638,690.87
000604	国投瑞银A	1.1749	588,699.47	680,712.20	691,662.01
750002	安信目标收益A	1.2095	813,408.64	1,038,217.55	1,098,508.37

以上场外基金投资中富国短债A已于2024年5月30日变现,实际变现金额为691,663.01元,该款项于2024年5月31日划入本基金托管账户。易方达信用债C、国投瑞银中高等债C、景顺长城景颐双利A、安信目标收益A于2024年5月31日变现,实际变现金额3,113,236.38元,该款项于2024年6月4日划入本基金托管账户。

3. 应收清算款

本基金2024年5月29日(基金最后运作日)的应收清算款余额836,132.89元(均为场外开放式基金赎回款)。上述款项中319,983.70元已于2024年5月30日划入本基金托管账户,剩余516,149.19元已于2024年5月31日划入本基金托管账户。

4. 其他资产

本基金2024年5月29日(基金最后运作日)的其他资产余额367.18元(均为销售服务费返还)。上述款项已于2024年6月3日划入本基金托管账户。

(二) 负债清偿情况

1. 应付赎回款

本基金2024年5月29日(基金最后运作日)的应付赎回款余额为2,693,725.71元,其中363,527.32元已于2024年5月30日支付,1,147,653.45元已于2024年6月3日支付,剩余1,182,544.94元已于2024年6月4日支付。

2. 应付管理人报酬

本基金2024年5月29日(基金最后运作日)的应付管理人报酬余额为4,698.78元,该款项已于2024年6月5日支付。

3. 应付托管费

本基金2024年5月29日(基金最后运作日)的应付托管费余额为907.63元,该款项已于2024年6月5日支付。

4. 应付销售服务费

本基金2024年5月29日(基金最后运作日)的应付销售服务费余额为2,332.87元,该款项已于2024年6月5日支付。

5. 应交税费

本基金2024年5月29日(基金最后运作日)的应交税费余额为1.27元,该款项已于2024年6月3日支付。

6. 其他负债

本基金于2024年5月29日(基金最后运作日)已确认的其他负债余额为36,991.50元。自2024年5月30日本基金进入清算程序起至2024年6月13日(清算终止日)止期间,其他负债中预提汇划费500.00元中的81.60元已支付,其中15.00元于2024年5月30日支付,27.95元于2024年6月3日支付,23.65元于2024年6月4日支付,15.00元于2024年6月5日支付,剩余预提汇划费418.40元、预提信息披露费20,491.50元和审计费用16,000.00元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5月30日 至2024年6月13日止 清算期间
一、清算收益		-9,580.12

1. 利息收入	(1)	633.15
2. 投资收益(损失以“-”填列)	(2)	118,585.08
3. 公允价值变动损益(损失以“-”填列)	(3)	-128,810.03
4. 其他收入(损失以“-”填列)	(4)	12.48
二、清算支出		8100
1. 其他费用(收入以“-”填列)		0.00
三、清算净收益		-9,580.12

注(1)利息收入为计提的自2024年5月30日本基金进入清算程序起至2024年6月13日(清算终止日)的货币资金的利息收入。

(2)投资收益为自2024年5月30日本基金进入清算程序起至2024年6月13日(清算终止日)的交易性债券利息收入4.52元、买卖基金差价收入119,111.49元及买卖债券差价收入409.55元扣减交易费用940.48元。

(3)公允价值变动损益为自2024年5月30日本基金进入清算程序起至2024年6月13日(清算终止日)的交易性债券投资公允价值变动损益-412.55元,交易性基金投资公允价值变动损益-128,398.28元。

(4)其他收入为计提的自2024年5月30日本基金进入清算程序起至2024年6月13日(清算终止日)的销售服务费返还收入。

(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
一、最后运作日2024年5月29日基金净资产		4,909,994.41
加:清算期间净收益		-9,580.12
清算期间以持有人权益转出		0.00
二、清算终止日2024年6月13日基金净资产		4,900,414.29

资产处置及负债清偿后,2024年6月13日(清算终止日)本基金剩余资产为人民币4,900,414.29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6月13日至清算款划出前一日货币资金产生的利息亦属基金份额持有人所有。

(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,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

(一) 备查文件目录

- 《国投瑞银兴顺3个月持有期混合型证券投资基金(FOF)清算审计报告》
- 《关于〈国投瑞银兴顺3个月持有期混合型证券投资基金(FOF)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.abssdic.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

国投瑞银兴顺3个月持有期混合型证券投资基金(FOF)基金财产清算小组

2024年6月17日