

国投瑞银岁丰利债券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05月15日

清算报告公告日：2019年06月25日

一、重要提示

国投瑞银岁丰利债券型证券投资基金(以下简称"本基金")由国投瑞银岁丰利一年期定期开放债券型证券投资基金于2018年9月4日转型而来,国投瑞银岁丰利一年期定期开放债券型证券投资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]342号文《关于准予国投瑞银岁丰利一年期定期开放债券型证券投资基金注册的批复》注册募集,于2015年7月21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》和国投瑞银岁丰利债券型证券投资基金的基金合同(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3月19日至2019年4月22日上午10:00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《关于终止国投瑞银岁丰利债券型证券投资基金的基金合同有关事项的议案》。本基金的最后运作日为2019年4月23日,于2019年4月24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4月24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 国投瑞银岁丰利债券型证券投资基金

基金简称 国投瑞银岁丰利债券

基金主代码 001137

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2015年7月21日

最后运作日(2019年4月23日)基金份额总额 9,752,145.79份

投资目标 本基金在有效控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资者实现超越业绩比较基准的投资业绩。

投资策略 本基金采取"自上而下"的债券分析方法,确定债券模拟组合,并管理组合风险。

本基金基于均衡收益率曲线,进行基本价值评估,计算不同资产类别、不同剩余期限债券品种的预期超额回报,并对预期超额回报进行排序,得到投资评级。在此基础上,卖出内部收益率低于均衡收益率的债券,买入内部收益率高于均衡收益率的债券。

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。在不同的时期,采用以上策略对组合收益和风险的贡献不尽相同,具体采用何种策略取决于债券组合允许的风险程度。

业绩比较基准 中债综合指数收益率

风险收益特征 本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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

下属分级基金的基金简称 国投瑞银岁丰利债券 A 国投瑞银岁丰利债券 C

下属分级基金的交易代码 001137 001138

最后运作日（2019年4月23日）下属分级基金的份额总额 6,325,814.27 份 3,426,331.52 份

三、基金运作情况

本基金由国投瑞银岁丰利一年期定期开放债券型证券投资基金于2018年9月4日转型而来，国投瑞银岁丰利一年期定期开放债券型证券投资基金经中国证监会证监许可[2015]342号文《关于准予国投瑞银岁丰利一年期定期开放债券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2015年7月6日至2015年7月17日向社会公开募集。本基金基金合同于2015年7月21日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为584,310,759.19份。自2015年7月21日至2019年4月23日期间，国投瑞银岁丰利一年期定期开放债券型证券投资基金及转型后的本基金正常运作。

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》等有关规定，经本基金份额持有人大会2019年4月22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4月24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：国投瑞银岁丰利债券型证券投资基金

报告截止日：2019年4月23日

单位：人民币元

最后运作日

2019年4月23日

资产：

银行存款 1,205,438.35

结算备付金 63,905.83

存出保证金 2,390.56

交易性金融资产 9,579,738.20

其中：股票投资 -

债券投资 9,579,738.20

应收利息 21,973.35

资产总计 10,873,446.29

负债：

应付赎回款 113,390.13

应付管理人报酬 4,965.37

应付托管费 1,655.14

应付销售服务费 805.25

其他负债 0.74

负债合计 120,816.63

所有者权益:

实收基金 9,752,145.79

未分配利润 1,000,483.87

所有者权益合计 10,752,629.66

负债和所有者权益总计 10,873,446.29

注:报告截止日 2019 年 4 月 23 日(基金最后运作日), 国投瑞银岁丰利债券 A 类基金份额净值人民币 1.106 元, 国投瑞银岁丰利债券 C 类基金份额净值人民币 1.097 元, 基金份额总额 9,752,145.79 份, 其中国投瑞银岁丰利债券 A 类基金份额 6,325,814.27 份, 国投瑞银岁丰利债券 C 类基金份额 3,426,331.52 份。

五、清算情况

自 2019 年 4 月 24 日至 2019 年 5 月 15 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 63,905.83 元, 该款项已于 2019 年 5 月 7 日转入本基金托管账户。

(2)本基金最后运作日存出保证金人民币 2,390.56 元, 该款项已于 2019 年 5 月 7 日转入本基金托管账户。

(3)本基金最后运作日交易性金融资产人民币 9,579,738.20 元, 系债券投资人民币 9,579,738.20 元, 其明细如下:

单位: 人民币元

债券

代码 债券

名称 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

估值总额

018006 国开 1702 101.33 94,540 9,610,899.46 9,579,738.20

以上交易性金融资产已于自 2019 年 4 月 24 日至 2019 年 5 月 15 日止的清算期间处置变现, 实际变现金额为人民币 9,590,275.35 元。

(4)本基金最后运作日应收利息人民币 21,973.35 元, 包括应收银行存款利息人民币 2,901.89 元、应收结算备付金利息人民币 159.60 元、应收交易保证金利息人民币 3.51 元、应收申购款利息人民币 1.18 元、应收赎回款利息人民币 677.79 元及应收债券利息人民币 18,229.38 元。其中, 应收申购款利息人民币 1.18 元及应收赎回款利息人民币 677.79 元已于 2019 年 5 月 7 日收回并划入本基金托管账户, 应收债券利息人民币 18,229.38 元已分别于 2019 年 4 月 25 日及 2019 年 4 月 26 日收回并划入本基金托管账户。

截至 2019 年 5 月 15 日应收利息余额为人民币 7,250.23 元, 其中应收银行存款利息人民币 7,045.26 元、应收结算备付金利息人民币 199.92 元、应收交易保证金利息人民币 5.05 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赎回款为人民币 113,390.13 元, 该款项已于 2019 年 4 月 24 日支付。

(2)本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 4,965.37 元, 该款项已于 2019 年 5 月 7 日支付。

(3)本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,655.14 元，该款项已于 2019 年 5 月 7 日支付。

(4)本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 805.25 元，该款项已于 2019 年 5 月 7 日支付。

(5)本基金最后运作日其他负债为人民币 0.74 元，系计提的应付赎回费，该款项已于 2019 年 4 月 24 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 4 月 24 日至

2019 年 5 月 15 日止清算期间

一、清算收益

1、利息收入（注 1） 5,260.20

2、投资收益 -39,907.86

3、公允价值变动损益 31,161.26

4、其他收入（注 2） 276.39

清算收益小计 -3,210.01

二、清算支出

1、交易费用 9.58

2、清算费用（注 3） -

清算支出小计 9.58

三、清算净收益 -3,219.59

注 1：利息收入系计提的自 2019 年 4 月 24 日起至 2019 年 5 月 15 日止清算期间的银行存款利息收入、债券利息收入、结算备付金利息收入、存出保证金利息收入及赎回款利息收入。

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《关于终止国投瑞银岁丰利债券型证券投资基金的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 4 月 23 日基金净资产 10,752,629.66

加：清算期间净收益 -3,219.59

清算期间持有人权益转出（注 1） -438,630.46

二、2019 年 5 月 15 日基金净资产 10,310,779.61

注 1：系本基金持有人于最后运作日（2019 年 4 月 23 日）提交的赎回申请，该款项已于 2019 年 4 月 25 日支付。

根据本基金的基金合同及《关于终止国投瑞银岁丰利债券型证券投资基金的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（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) 《国投瑞银岁丰利债券型证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《国投瑞银岁丰利债券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

国投瑞银岁丰利债券型证券投资基金基金财产清算小组

2019 年 5 月 15 日