

---

# 国投瑞银岁添利一年期定期开放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12月2日

清算报告公告日：2019年12月18日

## 一、 重要提示

国投瑞银岁添利一年期定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证监会证监许可[2013]787号文注册募集,于2013年8月21日正式生效,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《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《国投瑞银岁添利一年期定期开放债券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,某个开放期期满时,本基金份额持有人数量不满200人或本基金资产净值低于5000万元,经基金管理人与基金托管人协商一致后,可终止本基金合同并进行基金财产清算,无需召开基金份额持有人大会。本基金第六次办理赎回、转换转出业务的开放期为2019年11月11日至2019年11月15日的五个工作日,本次开放期届满时,本基金基金资产净值已经低于5000万元。为维护基金份额持有人利益,根据《基金合同》约定,经与本基金托管人协商一致,自2019年11月16日起,本基金依法进入基金财产清算程序,无需召开基金份额持有人大会审议。本基金最后运作日为2019年11月15日,于2019年11月16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11月16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	国投瑞银岁添利一年期定期开放债券型证券投资基金
基金简称	国投瑞银一年定期开放债券
基金主代码	000237
交易代码	000237
基金运作方式	契约型、以定期开放方式运作。本基金以1年为一个运作周期,每个运作周期为自基金合同生效日(包括基金合同生效日)或每个开放期结束之日次日起(包括该日)至1年后的对应日的前一日止。在运作周期内,本基

	金不办理申购与赎回业务（红利再投资除外），也不上市交易。本基金自每个运作周期结束之后第一个工作日起进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。
基金合同生效日	2013年8月21日
最后运作日（2019年11月15日）基金份额总额	14,156,493.56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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	本运作周期起始日对应的一年期定期存款利率（税后）+1%
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

### 三、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2013]787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发行人募集。本基金合同于 2013 年 8 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 357,861,685.05 份。自 2013 年 8 月 21 日至 2019 年 11 月 15 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》和《国投瑞银岁添利一年期定期开放债券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,某个开放期期满时,本基金份额持有人数量不满 200 人或本基金资产净值低于 5000 万元,经基金管理人与基金托管人协商一致后,可终止本基金合同并进行基金财产清算,无需召开基金份额持有人大会。本基金第六次办理赎回、转换转出业务的开放期为 2019 年 11 月 11 日至 2019 年 11 月 15 日的五个工作日,本次开放期届满时,本基金基金资产净值已经低于 5000 万元。为维护基金份额持有人利益,根据《基金合同》约定,经与本基金托管人协商一致,自 2019 年 11 月 16 日起,本基金依法进入基金财产清算程序,无需召开基金份额持有人大会审议。本基金最后运作日为 2019 年 11 月 15 日,于 2019 年 11 月 16 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(已审计)

会计主体:国投瑞银岁添利一年期定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2019 年 11 月 15 日

单位:人民币元

	最后运作日 2019 年 11 月 15 日
<b>资 产:</b>	
银行存款	17,759,852.83
结算备付金	1,149,259.97
存出保证金	1,715.49
交易性金融资产	3,397,819.20
其中:股票投资	-
债券投资	3,397,819.20

应收利息	23,783.91
应收证券清算款	-
资产总计	22,332,431.40
<b>负 债:</b>	
应付赎回款	5,430,196.91
应付管理人报酬	13,242.23
应付托管费	4,414.07
应付销售服务费	577.22
应付交易费用	484.90
应交税费	3,747.50
其他负债	79,044.88
负债合计	5,531,707.71
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	14,156,493.56
未分配利润	2,644,230.13
所有者权益合计	16,800,723.69
负债和所有者权益总计	22,332,431.40

## 五、 清算情况

自 2019 年 11 月 16 日至 2019 年 12 月 2 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 1,149,259.97 元。截至 2019 年 12 月 2 日结算备付金人民币 1,149,259.97 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 1,715.49 元。截至 2019 年 12 月 2 日存出保证金人民币 1,715.49 元，该款项将于清算结束后划入本基金托管账户。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 3,397,819.20 元，系本基金持有的债券投

资，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
136474	16 万达 04	100.46	10,000	995,667.78	1,004,600.00
108902	农发 1802	100.64	23,780	2,378,000.00	2,393,219.20

以上交易性金融资产已于自 2019 年 11 月 16 日至 2019 年 12 月 2 日止的清算期间处置变现，实际变现金额为人民币 3,381,612.14 元。

(4) 本基金最后运作日应收利息人民币 23,783.91 元，其中包括应收银行存款利息人民币 1,851.81 元、应收清算备付金利息人民币 2,837.20 元、应收交易保证金利息人民币 10.34 元、应收赎回款利息人民币 654.40 元及应收债券利息人民币 18,430.16 元。其中，应收债券利息人民币 18,430.16 元，已于清算期间收回并划入本基金托管账户。

截至 2019 年 12 月 2 日应收利息余额为人民币 11,408.23 元，其中应收银行存款利息人民币 5,936.26 元、应收清算备付金利息人民币 3,716.44 元、应收交易保证金利息人民币 11.70 元及应收赎回款利息人民币 1,743.83 元，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 5,430,196.91 元，该款项已于 2019 年 11 月 18 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 13,242.23 元，该款项将于清算结束后支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 4,414.07 元，该款项将于清算结束后支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 577.22 元，该款项将于清算结束后支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 484.90 元，该款项将于清算结束后支付。

(6) 本基金最后运作日应交税费为人民币 3,747.50 元，该款项将于清算结束后支付。

(7) 本基金最后运作日其他负债为人民币 79,044.88 元，其中包括应付赎回费 127.07 元已于 2019 年 11 月 18 日支付，剩余款项 78,917.81 元包含预提 2019 年信批费 69,917.81 元以及第 4 季度银行间账户维护费 9,000.00 元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11月16日至 2019年12月2日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	7,216.59
2、投资收益（注2）	8,010.23
3、公允价值变动损益（注3）	-24,151.42
4、其他收入	0.30
清算收益小计	-8,924.30
二、清算支出	
1、交易费用	56.87
2、其他费用	206.86
3、税金及附加	1.81
4、清算费用（注4）	-
清算支出小计	265.54
三、清算净收益	-9,189.84

注1：利息收入系计提的自2019年11月16日起至2019年12月2日止清算期间的银行存款利息和债券利息。其中，银行存款、交易保证金及结算备付金的利息收入为人民币4,965.05元，赎回款利息收入为人民币1,089.43元。本基金持有的债券投资农发1802、16万达04已分别于2019年11月18日和2019年11月20日处置完毕并收到债券利息为人民币1,162.11元。

注2：投资收益系交易性金融资产在清算期间处置资产变现产生的差价收入。

注3：公允价值变动损益系交易性金融资产在清算期间处置时公允价值变动结转产生。

注4：根据《关于国投瑞银岁添利一年期定期开放债券型证券投资基金基金财产清算及基金合同终止的公告》，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、 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11月15日基金净资产	16,800,723.69
加：清算期间净收益	-9,189.84
清算期间从持有人权益转出（注1）	-4,912,624.17
二、2019年12月2日基金净资产	11,878,909.68

注1：本基金份额持有人于最后运作日（2019年11月15日）提交的赎回申请，已于2019年11月19日支付基金赎回款。

根据本基金的《基金合同》及《关于国投瑞银岁添利一年期定期开放债券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。

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）、结算备付金及存出保证金款项。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）《国投瑞银岁添利一年期定期开放债券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岁添利一年期定期开放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

国投瑞银岁添利一年期定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

2019年12月18日