

---

# 国投瑞银顺业纯债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：交通银行股份有限公司

清算报告出具日：2021年4月14日

清算报告公告日：2021年4月16日

## 一、 重要提示

国投瑞银顺业纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2019]1027号文核准募集,于2019年12月26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”),基金托管人为交通银行股份有限公司(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》、《国投瑞银顺业纯债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,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《关于国投瑞银顺业纯债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》及《基金合同》,本基金最后运作日为2021年3月29日,于2021年3月30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2021年3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	国投瑞银顺业纯债债券型证券投资基金
基金简称	国投瑞银顺业纯债债券
基金主代码	007757
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2019年12月26日
最后运作日(2021年3月29日)基金份额总额	80,142.66份
投资目标	本基金在严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资人实现超越业绩比较基准的

	<p>投资业绩。</p>
投资策略	<p>本基金采取“自上而下”的债券分析方法，确定债券投资组合，并管理组合风险。</p> <p>1、基本价值评估</p> <p>债券基本价值评估的主要依据是均衡收益率曲线。本基金基于均衡收益率曲线，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>2、债券投资策略</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> <p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券的定价受市场利率、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> <p>4、组合构建及调整</p> <p>本公司设有固定收益部，结合各成员债券研究和投资管理经验，评估债券价格与内在价值偏离幅度是否可靠，据此构建债券投资组合。</p>
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，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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国投瑞银顺业纯债债券 A	国投瑞银顺业纯债债券 C
下属分级基金的交易代码	007757	011005
报告期末下属分级基金的份额总额	80,142.66 份	0.00 份

### 三、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2019]1027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2019年12月16日至2019年12月24日向社会公开募集。本基金基金合同于2019年12月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为216,739,761.56份。自2019年12月26日至2021年3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，《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2021年3月29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2021年3月30日刊登了《关于国投瑞银顺业纯债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》。本基金从2021年3月30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：国投瑞银顺业纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2021年3月29日

单位：人民币元

	<b>最后运作日</b> <b>2021年3月29日</b>
--	-----------------------------------

<b>资产：</b>	
银行存款	46,396.10
结算备付金	540.16
存出保证金	396.33
交易性金融资产	70,553.00
其中：股票投资	-
债券投资	70,553.00
应收利息	480.61
应收证券清算款	-
其他资产	3,400.00
资产总计	121,766.20
<b>负债：</b>	
应付赎回款	235.89
应付管理人报酬	20.34
应付托管费	6.84
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
其他负债	40,000.00
负债合计	40,263.07
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	80,142.66
未分配利润	1,360.47
所有者权益合计	81,503.13
负债和所有者权益总计	121,766.20

注：报告截止日 2021 年 3 月 29 日(基金最后运作日)，A 类基金份额净值 1.0170 元，基金份额总额 80,142.66 份；C 类基金份额净值 1.0170 元，基金份额总额 0.00 份。

## 五、 清算情况

自 2021 年 3 月 30 日至 2021 年 4 月 14 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540.16元。该款项已于2021年4月2日划入本基金托管账户。
- (2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币396.33元。该款项已于2021年4月2日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为人民币70,553.00元，系债券投资，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
010107	21国债(7)	100.79	700	70,700.00	70,553.00

以上交易性金融资产已于 2021 年 3 月 30 日处置变现，实际变现金额为人民币 70,971.95 元。

- (4) 本基金最后运作日应收利息为人民币480.61元，包括应收银行存款利息人民币6.44元、应收结算备付金利息人民币0.16元，应收存出保证金利息人民币0.16元及应收债券利息473.85元。截至2021年4月14日应收利息余额为人民币28.93元，包括应收银行存款利息人民币28.45元、应收结算备付金利息人民币0.24元及应收存出保证金利息人民币0.24元，该款项将于清算结束后划入本基金托管账户。
- (5) 本基金最后运作日其他资产为人民币3,400.00元。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，基金管理人决定由其承担本基金中央国债登记结算有限责任公司的债券交易账户费用1,500.00元、上海清算所的债券交易账户费用1,900.00元。截至2021年4月14日其他资产余额为人民币3,400.00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235.89元。该款项已于2021年3月30日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币20.34元。该款项已于2021年4月2日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币6.84元。该款项已于2021年4月2日支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币40,000.00元，系基金预提的2020年审计费，该款项已于2021年4月2日支付。

### 3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2021年3月30日至 2021年4月14日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	30.34
2、投资收益	-210.00
3、公允价值变动损益	147.00
清算收益小计	-32.66
二、清算支出	
1、交易费用	15.07
清算支出小计	15.07
三、清算净收益	-47.73

注1：利息收入系计提的自2021年3月30日起至2021年4月14日止清算期间的银行存款利息收入、结算备付金利息收入、存出保证金利息收入及债券利息收入。

### 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2021年3月29日基金净资产	81,503.13
加：清算期间净收益	-47.73
清算期间从持有人权益转出（注1）	-16,031.02
二、清算结束日2021年4月14日基金净资产	65,424.38

注1：本基金份额持有人于最后运作日（2021年3月29日）提交的赎回和转出申请，已于3月31日支付划出。

根据本基金的《基金合同》及《关于国投瑞银顺业纯债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。

#### 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）《国投瑞银顺业纯债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顺业纯债债券型证券投资基金清算事宜之法律意见》

### 2、存放地点

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免费查阅。

咨询电话：400-880-6868

国投瑞银顺业纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

2021年4月16日