

国投瑞银顺腾一年定期开放债券型发起式 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：兴业银行股份有限公司

清算报告出具日：2026年9月17日

清算报告公告日：2026年9月21日

一、重要提示

国投瑞银顺腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2021]3659号文《关于准予国投瑞银顺腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册募集，由基金管理人国投瑞银基金管理有限公司向社会公开发行募集，募集期间自2022年5月13日至2022年6月8日，基金合同于2022年6月9日正式生效，首次设立募集规模为1,010,001,350.00份基金份额。本基金为契约型定期开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司，注册登记机构为国投瑞银基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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》以及基金合同的有关规定，《基金合同》生效三年后继续存续的，自《基金合同》生效满三年后的基金存续期内，按下述规则处理：基金存续期内，发生以下任何一种情形时，基金合同将终止并进行基金财产清算，且无需召开持有人大会，同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序：（1）某个开放期届满后，本基金的基金份额持有人数量不满200人的；（2）某个开放期届满后，本基金的基金资产净值低于5000万元的。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。本基金本次开放期为2026年8月6日至2026年9月2日，截至本次开放期届满，本基金的基金资产净值低于5000万元，触发了上述《基金合同》的终止情形。本基金的最后运作日为2026年9月2日，自2026年9月3日进入清算期。本次清算期间为2026年9月3日至2026年9月17日。

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2026年9月3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	国投瑞银顺腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	国投瑞银顺腾一年定开债发起式

基金主代码	014384
交易代码	014384
基金运作方式	契约型、以定期开放方式运作
基金合同生效日	2022 年 6 月 9 日
最后运作日基金份额总额	15,392,122.99 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投资业绩。
投资策略	1、基本价值评估：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。 2、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、个券选择策略和信用债投资策略。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。 3、资产支持证券投资策略：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。 4、国债期货投资策略：为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用国债期货等金融衍生品。 5、组合构建及调整：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。
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	兴业银行股份有限公司

三、 基金运作情况

国投瑞银顺腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金由国投瑞银基金管

理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》公开募集。该基金为契约型定期开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,010,000,000.00 元，经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2022）验字第 60469016_H04 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《基金合同》于 2022 年 6 月 9 日正式生效，《基金合同》生效日的基金份额总额为 1,010,001,350.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,350.00 份基金份额。

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》以及基金合同的有关规定，《基金合同》生效三年后继续存续的，自《基金合同》生效满三年后的基金存续期内，按下述规则处理：基金存续期内，发生以下任何一种情形时，基金合同将终止并进行基金财产清算，且无需召开持有人大会，同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序：（1）某个开放期届满后，本基金的基金份额持有人数量不满 200 人的；（2）某个开放期届满后，本基金的基金资产净值低于 5000 万元的。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。根据《关于国投瑞银顺腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金的最后运作日为 2026 年 9 月 2 日，自 2026 年 9 月 3 日进入清算期。本次清算期间为 2026 年 9 月 3 日至 2026 年 9 月 17 日。

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：国投瑞银顺腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 9 月 2 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2026 年 9 月 2 日
资产：	
货币资金	16,786,275.02
资产总计	16,786,275.02
负债：	
应付管理人报酬	178,152.82
应付托管费	59,384.28

应交税费	95.46
其他负债	104,846.15
负债合计	342,478.71
净资产：	
实收资金	15,392,122.99
未分配利润	1,051,673.32
净资产合计	16,443,796.31
负债和净资产总计	16,786,275.02

注：报告截止日 2026 年 9 月 2 日（基金最后运作日），国投瑞银顺腾债券份额净值人民币 1.0683 元，基金份额总额 15,392,122.99 份。

五、 清算情况

自2026年9月3日至2026年9月17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：

（一）资产处置情况

1、货币资金

本基金最后运作日货币资金为人民币16,786,275.02元，其中银行存款本金人民币16,698,917.01元，银行存款应计利息人民币87,358.01元。于清算期间计提银行存款应计利息人民币2,401.65元，基金管理人将于清算结束后以自有资金垫付剩余银行存款应计利息款项。

（二）负债清偿情况

1、应付管理费

本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币178,152.82元。上述款项已于2026年9月3日支付。

2、应付托管费

本基金最后运作日应付托管费为人民币59,384.28元。上述款项已于2026年9月3日支付。

3、应交税费

本基金最后运作日应交税费为人民币95.46元。上述款项已于2026年9月3日支付。

4、其他负债

本基金最后运作日其他负债为人民币104,846.15元，其中应付交易费用人民币9,042.50元，其他应付款人民币255.00元，预提审计费人民币15,000.00元，预提信息披露费人民币80,548.65元。于清算期间2026年9月3日支付应付交易费用人民币9,042.50元。

截止至清算结束日其他负债为人民币95,803.65元，该款项于清算结束后支付。

（三）清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	附注	自2026年9月3日至2026年9月17日止清算期间
一、清算收益		-
1、利息收入	注1	2,401.65
清算收益小计		2,401.65
二、清算支出		-
清算支出小计		-
三、清算净收益（损失以“-”填列）		2,401.65

注1：利息收入为清算期间内计提的银行活期存款利息收入。

（四）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2026年9月2日基金净资产	16,443,796.31
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	2,401.65
二、清算结束日2026年9月17日基金净资产	16,446,197.96

根据《基金合同》的约定，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、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。

清算结束日次日至清算款划出日前一日的货币资金产生的利息归基金份额

持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将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），供清盘分配使用，待结息日回款后再返还给基金管理人。

（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，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

- 1、《国投瑞银顺腾一年定期开放债券型发起式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腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金清算事宜之法律意见》

（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.ubssdic.com>

（三）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

国投瑞银顺腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2026年9月17日