

**国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金**

**2022 年中期报告**

**2022 年 6 月 30 日**

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	42

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
<b>8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	44
<b>9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>10 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	46
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>46</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
<b>12 备查文件目录.....</b>	<b>47</b>
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金
基金简称	国投瑞银顺祺纯债债券
基金主代码	007260
交易代码	007260
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年7月9日
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	343,640,857.22 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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	<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 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 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 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 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。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国投瑞银基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王明辉	朱巍
	联系电话	400-880-6868	0571-87659806
	电子邮箱	service@ubssdic.com	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		400-880-6868	95527
传真		0755-82904048	0571-88268688
注册地址		上海市虹口区杨树浦路 168 号 20 层	杭州市萧山区鸿宁路 1788 号
办公地址		深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层	杭州市拱墅区延安路 368 号
邮政编码		518035	310006
法定代表人		傅强	张荣森

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的 管理人互联网网址	<a href="http://www.ubssdic.com">http://www.ubssdic.com</a>
基金中期报告备置地点	深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国投瑞银基金管理有限公司	深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层

### 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022年1月1日至2022年6月30日）
本期已实现收益	6,020,513.92
本期利润	5,530,681.51
加权平均基金份额本期利润	0.0161
本期加权平均净值利润率	1.46%
本期基金份额净值增长率	1.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	34,944,782.69
期末可供分配基金份额利润	0.1017
期末基金资产净值	382,086,471.80
期末基金份额净值	1.1119
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	11.19%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

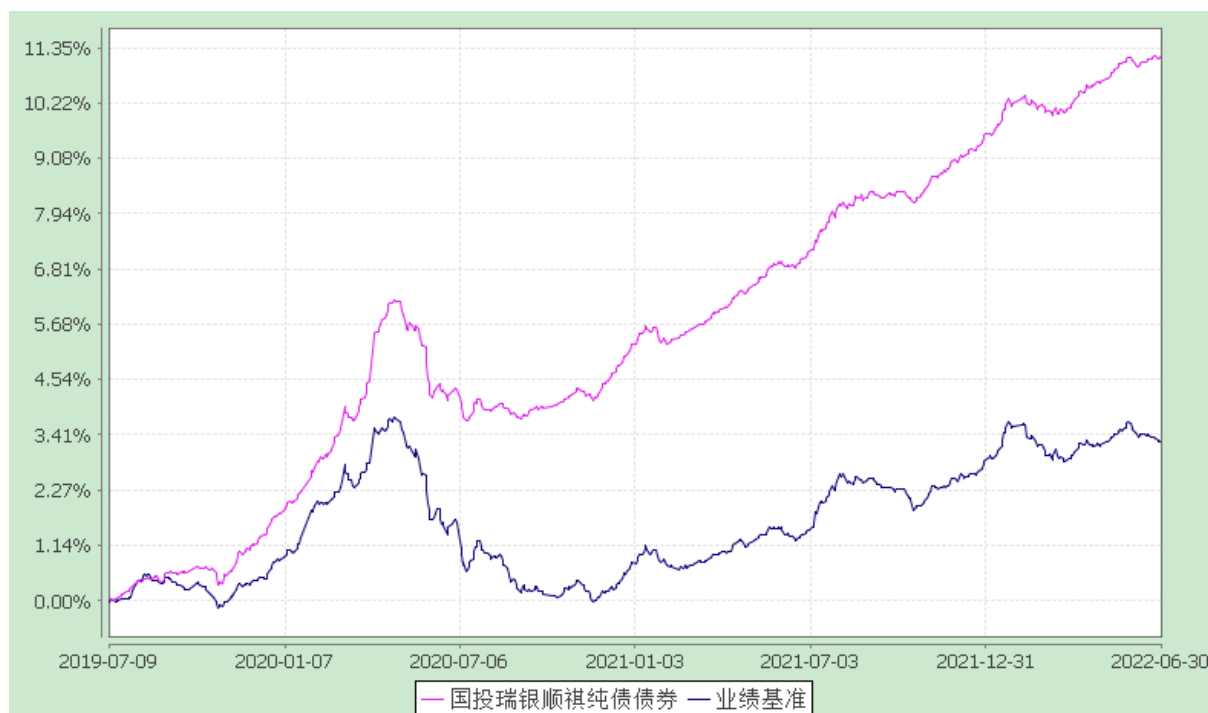
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.10%	0.03%	-0.24%	0.03%	0.34%	0.00%
过去三个月	0.90%	0.03%	0.29%	0.04%	0.61%	-0.01%
过去六个月	1.47%	0.04%	0.38%	0.05%	1.09%	-0.01%
过去一年	3.82%	0.04%	1.83%	0.05%	1.99%	-0.01%

自基金合同生效起至今	11.19%	0.06%	3.29%	0.06%	7.90%	0.00%
------------	--------	-------	-------	-------	-------	-------

注：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。本基金业绩比较基准为：中债综合指数收益率。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2019年7月9日至2022年6月30日）



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），原中融基金管理有限公司，经中国证券监督管理委员会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本1亿元人民币。公



司是中国第一家外方持股比例达到 49%的合资基金管理公司，公司股东为国投泰康信托有限公司（国家开发投资公司的控股子公司）及瑞士银行股份有限公司（UBS AG）。公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制架构，以"诚信、创新、包容、客户关注"作为公司的企业文化。截止 2022 年 6 月底，在公募基金方面，公司共管理 82 只基金，已建立起覆盖高、中、低风险等级的完整产品线；在专户理财业务方面，自 2008 年获得特定客户资产管理业务资格以来，已成功运作管理的专户产品涵盖了灵活配置型、稳健增利型等常规产品，还包括分级、期指套利、商品期货、QDII 等创新品种；在境外资产管理业务方面，公司自 2006 年开始为 QFII 信托计划提供投资咨询服务，具有丰富经验，并于 2007 年获得 QDII 资格。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋璐	本基金基金经理	2019-11-02	-	10	中国籍，硕士，具有基金从业资格。2012 年 6 月至 2015 年 3 月任中国人保资产管理股份有限公司信用评估部助理经理。2015 年 3 月加入国投瑞银基金管理有限公司固定收益部。曾任国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银新收益灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银优选收益混合型证券投资基金（原国投瑞银优选收益灵活配置混合型证券投资基金）、国投瑞银新活力定期开放混合型证券投资基金（原国投瑞银新活力灵活配置混合型证券投资基金）、国投瑞银岁增利债券型证券投资基金、国投瑞银兴颐多策略混合型证券投资基金、国投瑞银顺银 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国投瑞银和泰 6 个月定期开放债券型发起式

				证券投资基金、国投瑞银新机遇灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银顺荣 39 个月定期开放债券型证券投资基金、国投瑞银优化增强债券型证券投资基金及国投瑞银顺成 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。现任国投瑞银中高等级债券型证券投资基金、国投瑞银顺益纯债债券型证券投资基金、国投瑞银顺泓定期开放债券型证券投资基金、国投瑞银顺源 6 个月定期开放债券型证券投资基金、国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金、国投瑞银双债增利债券型证券投资基金、国投瑞银和旭一年持有期债券型证券投资基金、国投瑞银顺景一年定期开放债券型证券投资基金及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经理。
--	--	--	--	--

注：任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其系列法规和本基金《基金合同》等有关规定，本着恪守诚信、审慎勤勉，忠实尽职的原则，为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。在报告期内，基金的投资决策规范，基金运作合法合规，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人通过制度、流程和技术手段保证了公平交易原则的实现，确

保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督，形成了有效地公平交易体系。本报告期，本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

报告期内，管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。本年度同向交易价差专项分析的情况如下：

1、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差的溢价率进行分析，对两两组合同向交易成交价格均值的溢价率是否趋近于零进行 T 检验，检验在 95% 的可信水平下，价格均值的溢价率趋近于零是否存在检验不通过的情况。

2、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差优劣进行比较，区分买优、卖优、买次、卖次等情况分别分析两两组合在期间内交易时是否存在显著优于另一方的异常情况，

3、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差区分两两组合进行利益输送的模拟测算，检查在过去四个季度内，是否存在显著异常的情况。

检验分析结果显示，公司管理的所有投资组合，在过去连续四个季度内未发现存在违反公平交易原则的情况。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5% 的交易情况。

### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

上半年债券市场走势整体维持震荡。内部表现出现一定分化，信用债表现明显好于同期限的利率债。信用债中短久期适度下沉信用策略相对占优；利率债超长期限表现最好，其余各期限利率债持有收益差异不大。杠杆票息策略优于久期策略。回顾上

半年市场走势，一季度债券收益率先下后上，二季度短端收益率趋势下行，长端收益率窄幅震荡。上半年经济表现明显低于年初预期，主要是由于上海疫情以及房地产大幅下行，相应的，货币政策维持宽松，虽然受到海外加息的制约政策利率的调整较为克制，但是市场利率大幅下行，明显低于政策利率，资金面充裕。上半年大宗商品价格维持高位，国内仍面临一定的输入性通胀压力，但由于基数上行，PPI 同比读数维持下行趋势，上半年 CPI 仍处于较低水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.1119 元，本基金份额净值增长率为 1.47%，同期业绩比较基准收益率为 0.38%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，疫情过后三季度经济环比二季度改善的确定性较高，但是改善幅度仍有分歧，关于四季度的经济走势也存在分歧。我们认为经济反弹高度的关键在于房地产领域的复苏情况，当前暂时看不到房地产景气度明显改善的迹象，因此预计经济仍是弱复苏的格局。分部门来看，预计三季度基建仍将维持较高增速，且对上下游的拉动效果好于上半年，但持续性不强；制造业投资维持上半年的趋势；消费缓慢温和复苏；出口趋势下行但仍维持较强韧性；房地产在基数效应下同比改善但环比的复苏仍较为缓慢。货币政策宽松，维持流动性合理充裕偏高水平。CPI 下半年有上行压力，但主要是猪肉价格上涨的影响，核心 CPI 仍偏弱，预计对市场影响有限。

债券市场方面，宽松流动性下的资产荒逻辑仍在，且前期利率水平并未完全反应经济下行压力，期限利差仍维持在较高水平；最大风险点是政策发力逐渐得到传导，房地产和基建领域复苏强度超预期。目前来看，机会仍大于风险。但收益率近期大幅下行之后交易拥挤度有所上升，短端已经较为充分的定价了当前宽松的流动性，如果市场利率边际收敛，短端可能面临一定的调整压力。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括估值委员会、运营部及相关部门。

本基金的日常估值程序通常由运营部估值核算岗执行并由业务复核岗复核估值结

果，最终由估值核算员与产品托管人的估值结果核对一致。

本基金的特别估值程序由估值委员会秘书部门运营部在收到启动特殊估值程序的请求后，应通过估值核算人员及时与基金托管人沟通协商，必要时征求会计师事务所的专业意见，并将有关信息及材料一并报送全体估值委员会成员；估值委员会应综合考虑投资部门、研究部和运营部等各方面的意见和建议，并按照有关议事规则讨论审议，决定批准或不批准使用特殊估值调整；运营部应当根据经估值委员会审议通过的特别估值调整意见执行估值程序，准备特殊估值调整事项的临时公告，并发起信息披露审批流程；监察稽核部应当对特殊估值调整事项的相关信息披露进行合规审核。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本期已实现收益为 6,020,513.92 元，期末可供分配利润为 34,944,782.69 元。

本基金本报告期未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——国投瑞银基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国投瑞银基金管理有限公司编制和披露的国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金 2022 年年度中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.8.1	988,810.45	1,170,607.90
结算备付金		-	-
存出保证金		-	1,354.99
交易性金融资产	6.4.8.2	484,992,917.67	451,769,050.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		484,992,917.67	451,769,050.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.8.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.8.4	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		10,233.47	1,214.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.8.5	-	9,917,809.46
资产总计		485,991,961.59	462,860,036.37
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>

<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.8.3	-	-
卖出回购金融资产款		103,557,943.56	87,019,756.49
应付清算款		-	-
应付赎回款		57,510.93	114.25
应付管理人报酬		94,135.24	95,350.32
应付托管费		31,378.42	31,783.45
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.8.6	164,521.64	206,857.29
负债合计		103,905,489.79	87,353,861.80
<b>净资产：</b>		-	-
实收基金	6.4.8.7	343,640,857.22	342,690,750.28
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.8.8	38,445,614.58	32,815,424.29
净资产合计		382,086,471.80	375,506,174.57
负债和净资产总计		485,991,961.59	462,860,036.37

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.1119 元，基金份额总额 343,640,857.22 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>7,258,159.07</b>	<b>8,291,034.77</b>
1.利息收入		11,229.84	8,217,327.92
其中：存款利息收入	6.4.8.9	11,229.84	6,274.88
债券利息收入		-	8,211,053.04
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填		7,736,312.15	-857,541.98

列)			
其中：股票投资收益	6.4.8.10	-	-
基金投资收益	6.4.8.11	-	-
债券投资收益	6.4.8.12	7,736,312.15	-857,541.98
资产支持证券投资收益	6.4.8.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.8.14	-	-
衍生工具收益	6.4.8.15	-	-
股利收益	6.4.8.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.8.17	-489,832.41	931,241.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.8.18	449.49	7.46
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,727,477.56</b>	<b>1,990,440.79</b>
1. 管理人报酬		564,215.47	539,439.70
2. 托管费		188,071.80	179,813.28
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		867,269.87	1,159,039.53
其中：卖出回购金融资产支出		867,269.87	1,159,039.53
6. 信用减值损失	6.4.8.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.8.20	107,920.42	112,148.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>5,530,681.51</b>	<b>6,300,593.98</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>5,530,681.51</b>	<b>6,300,593.98</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>5,530,681.51</b>	<b>6,300,593.98</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计



一、上期期末净资产（基金净值）	342,690,750.28	-	32,815,424.29	375,506,174.57
二、本期期初净资产（基金净值）	342,690,750.28	-	32,815,424.29	375,506,174.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	950,106.94	-	5,630,190.29	6,580,297.23
（一）、综合收益总额	-	-	5,530,681.51	5,530,681.51
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	950,106.94	-	99,508.78	1,049,615.72
其中：1.基金申购款	2,699,284.31	-	280,573.97	2,979,858.28
2.基金赎回款	-1,749,177.37	-	-181,065.19	-1,930,242.56
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	343,640,857.22	-	38,445,614.58	382,086,471.80
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	342,093,269.40	-	17,981,460.60	360,074,730.00
二、本期期初净资产（基金净值）	342,093,269.40	-	17,981,460.60	360,074,730.00
三、本期增减变动额（减少	-262,330.64	-	6,286,268.06	6,023,937.42

以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	6,300,593.98	6,300,593.98
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-262,330.64	-	-14,325.92	-276,656.56
其中: 1.基金申购款	36,956.33	-	2,150.18	39,106.51
2.基金赎回款	-299,286.97	-	-16,476.10	-315,763.07
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	341,830,938.76	-	24,267,728.66	366,098,667.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：王彦杰，主管会计工作负责人：王彦杰，会计机构负责人：冯伟

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金(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[2019]577号《关于准予国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金注册的批复》核准，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，本基金为契约型开放式，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 300,104,000.07 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0410 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2019 年 7 月 9 日正式生效，基

金合同生效日的基金份额总额为 300,119,005.22 份基金份额，其中认购资金利息折合 15,005.15 份基金份额。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，基金托管人为浙商银行股份有限公司(以下简称“浙商银行”)。

本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可分离交易可转债的纯债部分、地方政府债、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不参与可转债(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债投资，也不进行股票。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，上述现金不包括结算备付金、存出保证、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中债综合指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年中期的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 重要会计政策和会计估计

### 6.4.5.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.5.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变

动计入当期损益的金融资产，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.5.3 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人

缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

## 6.4.6 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.6.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为 1,170,607.90 元、1,354.99 元、9,917,809.46 元和 1,214.02 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 1,170,872.62 元、1,355.59 元、0.00 元和 1,215.26 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 451,769,050.00 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 461,686,592.90 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和应付利息，金额分别为 87,019,756.49 元、114.25 元、95,350.32 元、31,783.45 元、20,836.14 元和 6,021.15 元。

新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付利息，金额分别为 87,025,777.64 元、114.25 元、95,350.32 元、31,783.45 元、20,836.14 元和 0.00 元。

(b)修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.6.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.6.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.7 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代



扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.8 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.8.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	988,810.45
等于：本金	988,689.24
加：应计利息	121.21
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	988,810.45

##### 6.4.8.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	478,739,549.34	6,641,367.67	484,992,917.67
	合计	478,739,549.34	6,641,367.67	484,992,917.67
		4		-387,999.34
资产支持证券	-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	478,739,549.34	6,641,367.67	484,992,917.67	-387,999.34

#### 6.4.8.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.8.4 买入返售金融资产

##### 6.4.8.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.8.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.8.5 其他资产

无。

#### 6.4.8.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3.77
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	15,257.72
其中：交易所市场	-
银行间市场	15,257.72
应付利息	-
信息披露费	59,507.37
审计费用	89,752.78
合计	164,521.64

#### 6.4.8.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	342,690,750.28	342,690,750.28
本期申购	2,699,284.31	2,699,284.31
本期赎回（以“-”号填列）	-1,749,177.37	-1,749,177.37
本期末	343,640,857.22	343,640,857.22

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.8.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,839,953.77	3,975,470.52	32,815,424.29
本期利润	6,020,513.92	-489,832.41	5,530,681.51
本期基金份额交易产生的变动数	84,315.00	15,193.78	99,508.78
其中：基金申购款	247,515.17	33,058.80	280,573.97
基金赎回款	-163,200.17	-17,865.02	-181,065.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,944,782.69	3,500,831.89	38,445,614.58

#### 6.4.8.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,227.26
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	2.58
合计	11,229.84

#### 6.4.8.10 股票投资收益

无。

#### 6.4.8.11 基金投资收益

无。

#### 6.4.8.12 债券投资收益

##### 6.4.8.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	7,954,169.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-217,857.26
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	7,736,312.15

#### 6.4.8.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	193,790,635.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	190,661,114.76
减：应计利息总额	3,342,670.76
减：交易费用	4,707.50
买卖债券差价收入	-217,857.26

#### 6.4.8.13 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.8.14 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.8.15 衍生工具收益

无。

#### 6.4.8.16 股利收益

无。

#### 6.4.8.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-489,832.41
——股票投资	-
——债券投资	-489,832.41
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-489,832.41

#### 6.4.8.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	449.49
合计	449.49

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.8.19 信用减值损失

无。

#### 6.4.8.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
银行间账户维护费	18,600.00
其他	60.27
合计	107,920.42

#### 6.4.9 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.9.1 或有事项

无。

##### 6.4.9.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.10 关联方关系

##### 6.4.10.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期无与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.10.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国投瑞银基金管理有限公司(“国投瑞银”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
浙商银行股份有限公司(“浙商银行”)	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.11 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.11.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 6.4.11.1.1 应支付关联方的佣金

无。

### 6.4.11.2 关联方报酬

#### 6.4.11.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	564,215.47	539,439.70
其中：支付销售机构的客户维护 费	1,034.98	-

注：支付基金管理人国投瑞银的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

#### 6.4.11.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	188,071.80	179,813.28

注：支付基金托管人浙商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.11.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收 入	交易金额	利息支 出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收 入	交易金额	利息支 出

浙商银行	9,861,560.00	-	-	-	-	-
------	--------------	---	---	---	---	---

#### 6.4.11.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.11.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.11.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.11.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	浙商银行	988,810.45	11,227.26	2,027,928.29

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.11.6 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.12 利润分配情况

无。

#### 6.4.13 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.13.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.13.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.13.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.13.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 103,557,943.56 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
140205	14 国开 05	2022-07-01	108.03	300,000.00	32,408,589.04

210203	21 国开 03	2022-07-01	102.98	200,000.00	20,596,986.30
140211	14 国开 11	2022-07-01	106.96	100,000.00	10,696,487.67
180206	18 国开 06	2022-07-01	106.78	100,000.00	10,677,630.14
190205	19 国开 05	2022-07-01	104.22	100,000.00	10,421,895.89
180303	18 进出 03	2022-07-01	103.75	100,000.00	10,375,331.51
210211	21 国开 11	2022-07-01	101.96	100,000.00	10,196,043.84
180408	18 农发 08	2022-07-01	102.49	90,000.00	9,224,368.77
合计				1,090,000.00	114,597,333.16

#### 6.4.13.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.14 金融工具风险及管理

#### 6.4.14.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可分离交易可转债的纯债部分、地方政府债、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不参与可转债（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债投资，也不进行股票投资。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制上述风险，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金管理人秉承全面风险控制的理念，将风险管理融入业务中，使风险控制与投资业务紧密结合，在董事会专业委员会监督管理下，建立了由督察长、合规与风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部、相关职能部门和业务部门构成的立体式风险管理架构体系。

#### 6.4.14.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在基金管理人制定的银行可投资名单内的已进行充分内部研究的信用等级较高的商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来



控制证券发行人的信用风险，信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过对单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.14.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,196,043.84	10,003,000.00
合计	10,196,043.84	10,003,000.00

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级部分一般为国债、政策性金融债、短期融资券、超短期融资券和中期票据。

#### 6.4.14.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.14.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	69,155,872.22	24,270,500.00
合计	69,155,872.22	24,270,500.00

注：同业存单评级取自第三方评级机构。

#### 6.4.14.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
AAA	279,600,639.97	236,459,150.00
AAA 以下	-	-
未评级	126,040,361.64	181,036,400.00
合计	405,641,001.61	417,495,550.00

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级部分一般为国债、政策性金融债、短期融资券、超短期融资券和中期票据。

#### 6.4.14.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.14.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.14.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，另一方面来自于基金持有的投资品种交易不活跃而带来的变现困难或不能以合理的价格变现。

##### 6.4.14.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.14.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格

因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.14.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人执行灵活的利率管理策略，借鉴瑞银全球资产管理公司海外管理经验，结合自主开发的估值系统管理利率风险，通过收益率利差分析、静态利差分析和期权调整利差等分析，计算组合证券的修正久期、利差久期、有效久期和有效凸性的风险控制指标，跟踪调整投资组合的久期和凸性等利率风险衡量指标，控制组合的利率风险。当预期债券市场利率下降时，加大固定利率证券的配置比例；当预期债券市场利率上升时，加大浮息证券的配置比例。通过改变浮息和固息证券的配置比例，控制证券投资组合的久期，防范利率风险。

##### 6.4.14.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	988,689.24	-	-	121.21	988,810.45
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	268,367,550.00	189,518,000.00	20,466,000.00	6,641,367.67	484,992,917.67
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	10,233.47	10,233.47
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	269,356,239.24	189,518,000.00	20,466,000.00	6,651,722.35	485,991,961.59
负债					
卖出回购金融资产款	103,549,748.22	-	-	8,195.34	103,557,943.56

应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	57,510.93	57,510.93
应付管理人报酬	-	-	-	94,135.24	94,135.24
应付托管费	-	-	-	31,378.42	31,378.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	164,521.64	164,521.64
负债总计	103,549,748.22	-	-	355,741.57	103,905,489.79
利率敏感度缺口	165,806,491.02	189,518,000.00	20,466,000.00	6,295,980.78	382,086,471.80
<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	1,170,607.90	-	-	-	1,170,607.90
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	1,354.99	-	-	-	1,354.99
交易性金融资产	167,790,650.00	226,753,900.00	57,224,500.00	-	451,769,050.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	9,917,809.46	9,917,809.46
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,214.02	1,214.02
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	168,962,612.89	226,753,900.00	57,224,500.00	9,919,023.48	462,860,036.37
负债					
短期借款	-	-	-	-	-

交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	87,019,756.49	-	-	-	87,019,756.49
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	114.25	114.25
应付管理人报酬	-	-	-	95,350.32	95,350.32
应付托管费	-	-	-	31,783.45	31,783.45
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	20,836.14	20,836.14
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	6,021.15	6,021.15
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	87,019,756.49	-	-	334,105.31	87,353,861.80
利率敏感度缺口	81,942,856.40	226,753,900.00	57,224,500.00	9,584,918.17	375,506,174.57

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.14.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率下降25个基点	1,548,917.12	2,488,683.02
市场利率上升25个基点	-1,535,705.34	-2,446,058.54	

#### 6.4.14.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.14.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，通过投资组合的分散化等方式，来主动应对可能发生的其他价格风险。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.14.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基 金资 产净 值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	484,992,917.67	126.93	451,769,050.00	120.31
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	484,992,917.67	126.93	451,769,050.00	120.31

### 6.4.15 公允价值

#### 6.4.15.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.15.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.15.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	484,992,917.67	451,769,050.00
第三层次	-	-
合计	484,992,917.67	451,769,050.00

##### 6.4.15.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

基金以导致各层次之间转换事项发生的当期期初为确认各层次之间的转换时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

### 6.4.16 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	484,992,917.67	99.79
	其中：债券	484,992,917.67	99.79
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	988,810.45	0.20
8	其他各项资产	10,233.47	0.00
9	合计	485,991,961.59	100.00

注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”，“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额，下同。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。



### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	415,837,045.45	108.83
	其中：政策性金融债	136,236,405.48	35.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	69,155,872.22	18.10
9	其他	-	-
10	合计	484,992,917.67	126.93

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	140205	14 国开 05	300,000	32,408,589.04	8.48
2	112208020	22 中信银行 CD020	300,000	29,595,600.82	7.75
3	112209033	22 浦发银行 CD033	300,000	29,595,600.82	7.75
4	1920047	19 宁波银行小微债 01	270,000	27,871,962.41	7.29
5	1928015	19 招商银	200,000	20,675,901.37	5.41

		行小微债 01			
--	--	------------	--	--	--

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券中，持有“21 国开 03”、“14 国开 05”，根据中国银行保险监督管理委员会（以下简称“中国银保监会”）银保监罚决字【2022】8 号，国家开发银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据等违法违规行为，被银保监会罚款 440 万元。持有“19 招商银行小微债 01”，根据中国银行保险监督管理委员会（以下简称“中国银保监会”）银保监罚决字【2022】21 号，招商银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在不良贷款余额 EAST 数据存在偏差等违法违规行为，被银保监会罚款 300 万元；根据中国银行保险监督管理委员会（以下简称“中国银保监会”）银保监罚决字【2021】16 号，招商银行股份有限公司因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等违法违规行为，被中国银

保监会罚款合计 7170 万元。持有“21 浦发银行 02”、“22 浦发银行 CD033”，根据中国银行保险监督管理委员会（以下简称“中国银保监会”）银保监罚决字【2022】25 号，浦发银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据等违法违规行为，被银保监会罚款 420 万元；根据中国银行保险监督管理委员会银保监罚决字【2021】27 号，上海浦东发展银行股份有限公司因监管发现的问题屡查屡犯、配合现场检查不力、内部控制制度修订不及时、信息系统管控有效性不足等违规行为，被中国银保监会罚款合计 6920 万元。持有“22 中信银行 CD020”，根据中国银行保险监督管理委员会（以下简称“中国银保监会”）银保监罚决字【2022】17 号，中信银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在漏报抵押物价值 EAST 数据等违法违规行为，被银保监会罚款 290 万元。持有“19 宁波银行小微债 01”，根据宁波银保监局行政处罚信息公开表（甬银保监罚决字【2021】81 号），宁波银行因信用卡业务管理不到位，被宁波银保监局罚款人民币 30 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分；根据宁波银保监局(甬银保监罚决字【2021】57 号)，宁波银行股份有限公司因贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储、开发贷款支用审核不严等违法违规行为，被宁波银保监局罚款人民币 275 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。基金管理人认为，上述公司被处罚事项有利于上述公司加强内部管理，上述公司当前总体生产经营和财务状况保持稳定，事件对上述公司经营活动未产生实质性影响，不改变上述公司基本面。本基金对上述证券的投资严格执行了基金管理人规定的投资决策程序。

除上述情况外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选库的情况。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,233.47

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,233.47

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,191	288,531.37	341,716,077.47	99.44%	1,924,779.75	0.56%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	84,679.27	0.02%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年7月9日）基金份额总额	300,119,005.22
本报告期期初基金份额总额	342,690,750.28
本报告期基金总申购份额	2,699,284.31
减：本报告期基金总赎回份额	1,749,177.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	343,640,857.22

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

- 1、自 2022 年 3 月 14 日起，王书鹏先生不再担任公司副总经理。
- 2、自 2022 年 4 月 28 日起，汪斌先生担任公司副总经理兼财务负责人。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金基金投资策略未发生变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内继续聘请普华永道中天会计师事务所提供审计服务，未发生更改聘会计师事务所的情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部

门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
天风证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人在租用证券机构交易单元上符合中国证监会的有关规定。本基金管理人将证券经营机构的注册资本、研究水平、财务状况、经营状况、经营行为以及通讯交易条件作为基金专用交易单元的选择标准，由研究部、投资部及交易部对券商进行考评并提出交易单元租用及更换方案。根据董事会授权，由公司执行委员会批准。

2、本基金本报告期租用证券公司交易单元未发生变更。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	报告期内基金管理人发布了关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告。	上海证券报、中国证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	报告期内基金管理人发布了本基金基金经理变更的公告。	中国证券报，中国证监会基金电子披露网站	2022-01-28
3	报告期内基金管理人发布了高级管理人员变更的公告。	证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-15
4	报告期内基金管理人发布了高级管理人员变更的公告。	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-30

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101-20220630	100,004,000.00	0.00	0.00	100,004,000.00	29.10%
	2	20220101-20220630	94,472,366.56	0.00	0.00	94,472,366.56	27.49%
	3	20220101-20220630	147,239,710.91	0.00	0.00	147,239,710.91	42.85%

#### 产品特有风险

投资者应关注本基金单一投资者持有份额比例过高时，可能出现以下风险：

#### 1、赎回申请延期办理的风险

单一投资者大额赎回时易触发本基金巨额赎回的条件，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要部分延期办理的风险。

#### 2、基金净值大幅波动的风险

单一投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；单一投资者大额赎回时，相应的赎回费归入基金资产以及赎回时的份额净值的精度问题均可能引起基金份额净值出现较大波动。

#### 3、基金投资策略难以实现的风险

单一投资者大额赎回后，可能使基金资产净值显著降低，从而使基金在拟参与银行间市场交易等投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。

#### 4、基金财产清算（或转型）的风险

根据本基金基金合同的约定，基金合同生效后的存续期内，若连续 60 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，基金合同将终止，并根据基金合同的约定进行基金财产清算。单一投资者大额赎回后，可能造成基金资产净值大幅缩减而直接导致触发本基金合同约定的终止及清算条款，对本基金的继续存续产生较大影响。

#### 5、召开基金份额持有人大会及表决时可能存在的风险

由于单一机构投资者所持有的基金份额占比较高，在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时，单一机构投资者将拥有高的投票权重。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

《关于准予国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]577号）

《关于国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金备案确认的函》（机构部函[2019]1709号）

《国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金基金合同》

《国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金基金托管协议》

国投瑞银基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批件

其他在中国证监会指定媒介上公开披露的基金份额净值公告、定期报告及临时公告

### 12.2 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>

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅

咨询电话：国投瑞银基金管理有限公司客户服务热线 400-880-6868、0755-83160000

国投瑞银基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日