

---

# 国投瑞银顺悦3个月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：宁波银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年10月18日

清算报告公告日：2024年10月22日

## 一、重要提示

国投瑞银顺悦3个月定期开放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]775号《关于准予国投瑞银顺悦3个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》注册,于2019年12月31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”),基金托管人为宁波银行股份有限公司(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》以及基金合同的有关规定,《基金合同》生效后的存续期内,发生以下任何一种情形时,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,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)连续两个开放期届满后,本基金的基金份额持有人数量不满200人的;(2)连续两个开放期届满后,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。本基金在上个开放期届满后基金资产净值已低于5,000万元。本基金本次开放期为2024年10月8日,截至2024年10月8日日终,本基金资产净值低于5,000万元,即本基金已连续两个开放期届满后基金资产净值低于5,000万元,触发了上述基金合同的终止情形。根据基金合同约定,本基金的最后运作日为2024年10月8日,自2024年10月9日起进入基金财产清算程序。

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2024年10月9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	国投瑞银顺悦 3 个月定期开放债券型证券投资基金
基金简称	国投瑞银顺悦债券
基金主代码	007445
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	2019 年 12 月 31 日

最后运作日基金份额总额	512,771.60 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	<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。	
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国投瑞银顺悦债券 A	国投瑞银顺悦债券 D
下属分级基金的基金代码	007445	020479

最后运作日下属分级基金的份额总额	412,368.62 份	100,402.98 份
------------------	--------------	--------------

### 三、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2019]775号《关于准予国投瑞银顺悦3个月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2019年10月14日起至2019年12月30日向社会公开募集。基金合同于2019年12月31日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为210,308,998.69份。自2019年12月31日至2024年10月8日期间，本基金正常运作。

根据市场环境变化及基金运作情况，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》和本基金基金合同的有关规定，本基金在上个开放期届满后基金资产净值已低于5000万元，本基金本次开放期为2024年10月8日，截至2024年10月8日日终，本基金资产净值低于5000万元，即本基金已连续两个开放期届满后基金资产净值低于5000万元，触发了基金合同约定的终止情形，无需召开基金份额持有人大会，进入资产变现及清算程序。本基金的最后运作日为2024年10月8日，自2024年10月9日起进入清算期。本基金清算期自2024年10月9日至2024年10月18日止。

### 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：国投瑞银顺悦3个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2024年10月8日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2024年10月8日
<b>资产：</b>	
货币资金	632,815.19
结算备付金	-
存出保证金	1,764.86

交易性金融资产	-
其中：基金投资	-
其中：债券投资	-
应收清算款	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	634,580.05
<b>负债：</b>	
应付赎回款	-
应付管理人报酬	190.47
应付托管费	63.46
应付销售服务费	-
应交税费	-
其他负债	36,967.65
负债合计	37,221.58
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	512,771.60
未分配利润	84,586.87
所有者权益合计	597,358.47
负债和所有者权益总计	634,580.05

注：报告截止日 2024 年 10 月 8 日（基金最后运作日），基金份额总额 512,771.60 份，其中 A 类基金份额净值 1.1947 元，基金份额 412,368.62 份，D 类基金份额净值 1.0428 元，基金份额 100,402.98 份。

## 五、 清算情况

自 2024 年 10 月 9 日至 2024 年 10 月 18 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、银行存款

本基金最后运作日货币资金为人民币632,815.19元，其中银行存款本金人民币632,547.46元，银行存款应计利息人民币267.73元。基金管理人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。

## 2、存出保证金

本基金最后运作日存出保证金为人民币1,764.86元，其中本金人民币1,763.50元，应计利息人民币1.36元。于清算期间计提应计利息人民币0.80元，自货币资金划入至存出保证金人民币114.58元。截止清算结束日存出保证金为人民币1,880.24元，其中本金人民币1,878.08元，应计利息人民币2.16元。基金管理人于清算结束后以自有资金垫付剩余存出保证金本金和应计利息款项。

## (二) 负债清偿情况

### 1、应付管理人报酬

本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币190.47元。截止清算结束日应付管理人报酬为人民币190.47元，上述款项尚未支付。

### 2、应付托管费

本基金最后运作日应付托管费为人民币63.46元。截止清算结束日应付托管费为人民币63.46元，上述款项尚未支付。

### 3、其他负债

本基金最后运作日其他负债为人民币36,967.65元，其中预提清算审计费人民币36,967.65元。截止清算结束日其他负债为人民币36,967.65元，上述款项尚未支付。

## (三) 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	附注	2024年10月9日 至2024年10月18日止 清算期间
一、清算收益		165.11
1、利息收入	(1)	165.11
二、清算支出		
1、其他费用(收入以“-”号填列)		-
三、清算净收益		165.11

注：（1）利息收入为计提的自2024年10月9日本基金进入清算程序起至2024年10月18日（清算终止日）的银行存款、存出保证金的利息收入，由基金管理人以自有资金先行垫付，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。垫付资金及其孳生的利息将于清算终止日后返还给基金管理人。

#### （四）清算期间的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	附注	金额
一、最后运作日2024年10月8日基金净资产		597,358.47
加：清算期间净收益		165.11
清算期间从持有人权益转出	(1)	-43,821.36
二、清算终止日2024年10月18日基金净资产		553,702.22

注：（1）清算期间从持有人权益转出系本基金份额持有人于最后运作日2024年10月8日提交的赎回和转换申请，已于2024年10月10日完成基金赎回款支付及基金转换。

根据本基金基金合同的约定，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和存出保证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、《国投瑞银顺悦3个月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顺悦3个月定期开放债券型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>、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

国投瑞银顺悦3个月定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

2024年10月22日