
国投瑞银岁赢利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：2021年4月21日

清算报告公告日：2021年4月23日

一、 重要提示

国投瑞银岁赢利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),系由国投瑞银岁赢利一年期定期开放债券型证券投资基金于2019年4月23日转型而来。国投瑞银岁赢利一年期定期开放债券型证券投资基金经中国证监会证监许可[2015]2639号文注册募集,2016年3月29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”)。

根据市场环境变化及基金运作情况,为更好地保护基金份额持有人的利益,基金管理人依据《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《国投瑞银岁赢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,提议终止《基金合同》。

本基金于2021年3月4日至2021年4月6日上午10:00期间以通讯方式召开基金份额持有人大会,会议审议并表决通过了《关于终止国投瑞银岁赢利债券型证券投资基金的基金合同有关事项的议案》。本基金的最后运作日为2021年4月7日,于2021年4月8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4月8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

基金简称	国投瑞银岁赢利债券
基金主代码	002355
交易代码	002355
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月29日
报告期末基金份额总额	2,279,329.54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>1、资产配置</p> <p>本基金采取稳健灵活的投资策略，通过固定收益类金融工具的主动管理，力求降低基金净值波动风险，并根据对股票市场的趋势研判，适度参与股票投资，力求提高基金总体收益率。</p> <p>2、债券投资管理</p> <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>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、股票投资策略</p> <p>基金管理人将把握股票市场出现的趋势性或结构性投资机会，在本基金合同约定范围内直接投资股票市场，努力获取超额收益。在股票投资方面，基金管理人将遵循稳健和灵活兼顾的投资思路。</p> <p>4、国债期货投资策略</p> <p>为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。</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，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

本基金由国投瑞银岁赢利一年期定期开放债券型证券投资基金于2019年4月23日转型而来，国投瑞银岁赢利一年期定期开放债券型证券投资基金经中国证监会证监许可[2015]2639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募集，基金合同于2016年3月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为826,765,133.16份。自2016年3月29日至2021年4月7日期间，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》等有关规定，经本基金份额持有人大会于2021年4月6日表决通过，决定终止基金合同，并对本基金进行变现及清算程序。本基金从2021年4月8日起进入清算期，清算终止日为2021年4月21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：国投瑞银岁赢利债券型证券投资基金

报告截止日：2021年4月7日

单位：人民币元

	最后运作日 2021年4月7日
资产：	
银行存款	2,581,204.73
结算备付金	3,762.52
存出保证金	766.29
交易性金融资产	
其中：股票投资	
债券投资	
应收利息	224.44
其他资产	
应收证券清算款	
资产总计	2,585,957.98
负债：	
应付赎回款	
应付管理人报酬	340.82
应付托管费	113.59
应付销售服务费	
应付交易费用	

应交税费	122.78
其他负债	8,250.00
负债合计	8,827.19
所有者权益：	
实收基金	2,279,329.54
未分配利润	297,801.25
所有者权益合计	2,577,130.79

注：报告截止日2021年4月7日（基金最后运作日），岁赢利基金份额净值1.131元，基金份额总额2,279,329.54份。

五、 清算情况

自2021年4月8日至2021年4月21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3,762.52元。截至2021年4月21日结算备付金人民币3,762.52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为人民币766.29元。截至2021年4月21日存出保证金人民币766.29元，该款项将于清算结束后划入本基金托管账户。

(3) 本基金最后运作日应收利息为人民币224.44元，包括应收银行存款利息人民币12.76元、应收结算备付金利息人民币0.85元、应收存出保证金利息人民币0.27元、应收申购款利息人民币0.02元及应收赎回款利息人民币210.54元。

截至2021年4月21日应收利息余额为人民币578.54元，其中应收银行存款利息人民币364.03元、应收结算备付金利息人民币3.23元、应收存出保证金利息人民币0.69元、应收申购款利息人民币0.02元及应收赎回款利息人民币210.57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管理人报酬为人民币340.82元，该款项将于清算结束后支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币113.59元，该款项将于清算结束后支付。

(3) 本基金最后运作日应交税费为人民币122.78元。该款项已于2021年4月8日支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币8,250.00元，包括计提审计费用人民币8,000.00元及其他应付款250.00元。截至2021年4月21日其他负债余额为人民币8,240.00元，包括计提的审计费8,000.00元及其他应付款240.00元，该款项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 2021 年 4 月 8 日至 2021 年 4 月 21 日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注 1）	354.10
4、其他收入（注 2）	0.15
清算收益小计	354.25
二、清算支出	
1、交易费用	
清算支出小计	
三、清算净收益	354.25

注1：利息收入系计提的自2021年4月8日起至2021年4月21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赎回款利息收入。

注2：其他收入系最后运作日基金份额持有人发生赎回业务产生的赎回费收入。

4、清算期间剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2021 年 4 月 7 日基金净资产	2,577,130.79
加：清算期间净收益	354.25
清算期间从持有人权益转出（注 1）	-623.49
二、清算结束日 2021 年 4 月 21 日基金净资产	2,576,861.55

注1：本基金份额持有人于最后运作日（2021年4月7日）提交的赎回申请，已于2021年4月9日支付划出。

根据本基金的《基金合同》及《关于终止国投瑞银岁赢利债券型证券投资基金的基金合同有关事项议案的说明》，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）、结算备付金款及存出保证金款项。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）《国投瑞银岁赢利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赢利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

国投瑞银岁赢利债券型证券投资基金

基金财产清算小组

二〇二一年四月二十一日