
国投瑞银顺鑫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：招商银行股份有限公司

清算报告出具日：2026年8月24日

清算报告公告日：2026年8月26日

一、 重要提示

国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系由国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金转型而来。国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资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[2016]1375号文《关于准予国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型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2016年7月4日至2016年7月8日，基金合同于2016年7月13日正式生效，首次设立募集规模为1,001,147,213.42份基金份额。

根据国投瑞银顺鑫一年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会于2018年6月8日表决通过的《关于国投瑞银顺鑫一年定期开放债券型证券投资基金转型相关事项的议案》，自2018年7月10日起变更为本基金，转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略、基金费率、估值方法、基金份额的申购赎回等相关内容按照《国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金合同》相关规定进行运作。

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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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，本基金份额持有人数量不满200人的；（2）某个开放期届满后，本基金资产净值低于5000万元的。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。本基金本次开放期为2026年7月10日至2026年8月6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8月6日，自2026年8月7日进入清算期。本次清算期间为2026年8月7日至2026年8月24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8月7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	国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	国投瑞银顺鑫债券
基金主代码	002964
交易代码	002964
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	2018 年 7 月 10 日
最后运作日基金份额总额	9,935,372.57 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，力争为投资人实现超越业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	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。 （一）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。 （二）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。 （三）对于中小企业私募债券，本基金将重点关注发行人财务状况、个券增信措施等因素，以及对基金资产流动性的影响，在充分考虑信用风险、流动性风险的基础上，进行投资决策。 （四）组合构建及调整 管理人结合债券研究管理团队的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	招商银行股份有限公司

三、 基金运作情况

国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型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 1,000,935,991.93 元，经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2016）验字第 60469016_H05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《基金合同》于 2016 年 7 月 13 日正式生效，《基金合同》生效日的基金份额总额为 1,001,147,213.42 份基金份额，其中认购资金利息折合 211,221.49 份基金份额。根据国投瑞银顺鑫一年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会于 2018 年 6 月 8 日表决通过的《关于国投瑞银顺鑫一年定期开放债券型证券投资基金转型相关事项的议案》，自 2018 年 7 月 10 日起变更为本基金。自 2018 年 7 月 10 日至 2026 年 8 月 6 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》以及基金合同的有关规定，基金存续期内，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，本基金份额持有人数量不满 200 人的；（2）某个开放期届满后，本基金资产净值低于 5000 万元的。根据《关于国投瑞银顺鑫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 8 月 6 日，自 2026 年 8 月 7 日起进入清算期。本次清算期间为 2026 年 8 月 7 日至 2026 年 8 月 24 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：国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 8 月 6 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日
	2026 年 8 月 6 日
资产：	
货币资金	10,524,455.18
存出保证金	5,231.19
资产总计	10,529,686.37
负债：	
应付赎回款	10.46
应付管理人报酬	597.87
应付托管费	199.29
应交税费	27,124.93
其他负债	107,440.13
负债合计	135,372.68
净资产：	
实收资金	9,935,372.57
未分配利润	458,941.12
净资产合计	10,394,313.69
负债和净资产总计	10,529,686.37

注：报告截止日 2026 年 8 月 6 日（基金最后运作日），国投瑞银顺鑫债券份额净值人民币 1.0462 元，基金份额总额 9,935,372.57 份。

五、 清算情况

自2026年8月7日至2026年8月24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10,524,455.18元，其中银行存款本金人民币10,511,564.45元，银行存款应计利息人民币12,890.73元。于清算期

间计提应计利息人民币1,834.41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5,231.19元，其中本金人民币5,229.72元，应计利息人民币1.47元。于清算期间计提应计利息人民币0.90元。截止至清算结束日存出保证金为人民币5,232.09元，其中本金人民币5,229.72元，应计利息人民币2.37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、应付赎回款

本基金最后运作日应付赎回款为人民币10.46元。上述款项已于2026年8月7日支付。

2、应付管理费

本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币597.87元。上述款项已于2026年8月10日支付。

3、应付托管费

本基金最后运作日应付托管费为人民币199.29元。上述款项已于2026年8月10日支付。

4、应交税费

本基金最后运作日应交税费为人民币27,124.93元。上述款项已于2026年8月10日支付。

5、其他负债

本基金最后运作日其他负债为人民币107,440.13元，其中其他应付款人民币1,885.00元，应付交易费用人民币11,335.03元，预提审计费人民币17,848.24元，预提信息披露费人民币71,671.86元，预提中债登账户维护费人民币1,500.00元，预提上清所账户维护费及查询费人民币3,200.00元。于清算期间2026年8月12日前（含当日）支付中债登账户维护费人民币1,500.00元、其他应付款人民币

1,585.00元、应付交易费用人民币4,925.03元。截止至清算结束日其他负债为人民币99,430.10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8月7日至2026年8月24日止清算期间
一、清算收益		-
1、利息收入	注（1）	1,835.31
清算收益小计		1,835.31
二、清算支出		-
清算支出小计		-
三、清算净收益（损失以“-”填列）		1,835.31

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、存出保证金利息收入。

（四）清算期间的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	附注	金额
一、最后运作日2026年8月6日基金净资产		10,394,313.69
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）		1,835.31
二、清算结束日2026年8月24日基金净资产		10,396,149.00

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、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、《国投瑞银顺鑫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鑫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

国投瑞银顺鑫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8月24日