

中金衡利 1 年定期开放债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告出具日期：2021 年 8 月 3 日

报告公告日期：2021 年 8 月 6 日

1 重要提示

中金衡利1年定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“中金衡利基金”）经中国证监会证监许可[2020]108号文注册，2020年6月3日基金合同生效。本基金的基金管理人为中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”），本基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“邮储银行”）。

根据《中金衡利1年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》”或“基金合同”）“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效后，连续20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，基金管理人应当在定期报告中予以披露；开放期最后一日日终，若本基金的基金资产净值加上基金开放期最后一日交易申请确认的申购确认金额及转换转入确认金额，扣除赎回确认金额及转换转出确认金额后的余额低于5000万元或基金份额持有人数量不满200人的，本基金将根据基金合同的约定清算并终止，无需召开基金份额持有人大会。”

截至2021年6月28日日终（本次开放期最后一日），本基金基金资产净值加上基金开放期最后一日交易申请确认的申购确认金额及转换转入确认金额，扣除赎回确认金额及转换转出确认金额后的余额为46,812,430.03元，低于5000万元，出现触发《基金合同》终止的情形。本基金将根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会。

本基金自2021年6月29日起进入清算期，由基金管理人中金基金、基金托管人邮储银行、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

2 基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	中金衡利1年定期开放债券型证券投资基金
基金简称	中金衡利1年
基金主代码	009158
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2020年6月3日
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
最后运作日(2021年6月28日)	
基金份额总额	494,287,034.84份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”的分析方法,综合分析宏观经济周期与形势、货币政策、财政政策、利率走势、资金供求、流动性风险、信用风险等因素,分析比较债券市场、股票市场及现金类资产的收益风险特征,动态调整各大类资产的投资比例,控制投资组合的系统性风险。具体包括:1、资产配置策略;2、普通债券投资策略;3、可转换债券投资策略;4、可交换债券投资策略;5、资产支持证券投资策略;6、国债期货投资策略;7、股票投资策略;8、存托凭证投资策略;9、信用衍生品投资策略。
业绩比较基准	中债-综合全价(总值)指数收益率 \times 90%+沪深300指数收益率 \times 5%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整) \times 5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,理论上其预期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。

3 基金最后运作日财务会计报告(经审计)

资产负债表

会计主体: 中金衡利1年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日: 2021年6月28日(基金最后运作日)

单位: 人民币元

资产	本期末 2021年6月28日 (基金最后运作日)
资产:	-
银行存款	515,757,047.35
结算备付金	808,266.83
存出保证金	514,665.98

交易性金融资产	55,481,310.50
其中：股票投资	55,481,310.50
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
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	48,799.70
应收股利	-
应收申购款	19,880.72
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	572,629,971.08
负债和所有者权益	本期末 2021 年 6 月 28 日 (基金最后运作日)
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	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	68,301,494.40
应付管理人报酬	362,636.83
应付托管费	96,703.17
应付销售服务费	-
应付交易费用	292,662.49
应交税费	19,321.11
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	104,432.85
负债合计	69,177,250.85
所有者权益：	-
实收基金	494,287,034.84
未分配利润	9,165,685.39
所有者权益合计	503,452,720.23
负债和所有者权益总计	572,629,971.08

注：报告截止日 2021 年 6 月 28 日（基金最后运作日），中金衡利基金份额净值 1.0185 元，基金份额总额 494,287,034.84 份。

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

中金衡利1年定期开放债券型证券投资基金依据中国证监会于2020年1月13日证监许可[2020]108号《关于准予中金衡利1年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》注册，由中金基金依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中金衡利1年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》）、《中金衡利1年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称《招募说明书》）和《中金衡利1年定期开放债券型证券投资基金基金份额发售公告》公开募集。中金衡利基金为契约型、定期开放式基金，存续期限为不定期。中金衡利基金的基金管理人为中金基金，基金托管人为邮储银行。

中金衡利基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、邮储银行、北京蛋卷基金销售有限公司、东方财富证券股份有限公司及国金证券股份有限公司等共同销售，募集期为2020年5月6日起至2020年5月29日。经向中国证监会备案，《中金衡利1年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”）于2020年6月3日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为1,239,481,896.86份（含利息转份额544,454.83份），发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

根据《基金合同》和《招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券等）、债券回购、货币市场工具、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行上市的股票）、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、资产支持证券、国债期货、银行存款、同业存单、信用衍生品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相关规定）。

4.2 清算原因

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效后，连续20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，基金管理人应当在定期报告中予以披露；开放期最后一日日终，若本基金的基金资产净值加上基金开放期最后一日交易申请确认的申购确认金额及转换转入确认金额，扣除赎回确认金额及转换转出确认金额后的余额低于5000万元或基金份额持有人数量不

满 200 人的，本基金将根据基金合同的约定清算并终止，无需召开基金份额持有人大会。”

截至 2021 年 6 月 28 日日终（本次开放期最后一日），本基金基金资产净值加上基金开放期最后一日交易申请确认的中购确认金额及转换转入确认金额，扣除赎回确认金额及转换转出确认金额后的余额为 46,812,430.03 元，低于 5000 万元，出现触发《基金合同》终止的情形。本基金将根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会。

4.3 清算起始日

本基金于 2021 年 6 月 29 日起进入清算期，清算期为 2021 年 6 月 29 日至 2021 年 8 月 3 日。本基金将清算后的全部剩余财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。

4.4 清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

5 清算情况

自 2021 年 6 月 29 日至 2021 年 8 月 3 日止为本基金清算报告期，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。具体清算情况如下：

5.1 清算费用

按照《基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

5.2 资产处置情况

（1）银行存款、应收款项资产处置情况

序号	项目	运作终止日账面价值	清算金额	清算期期末账面价值
1	银行存款	515,757,047.35	-469,092,338.66	46,664,708.69
2	应收利息	48,799.70	11,687.67	60,487.37

（2）金融资产处置情况

序号	项目	运作终止日账面价	清算金额	清算期期末账面价值
----	----	----------	------	-----------

		值		
1	股票投资	55,481,310.50	55,407,190.24	0

5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 68,301,494.40 元, 该款项已于清算期内支付完毕。

(2) 本基金自 2021 年 6 月 29 日进入清算期, 按照《基金合同》第六部分“基金份额的申购与赎回”的规定, 2021 年 6 月 29 日确认 2021 年 6 月 28 日的赎回申请金额为人民币 461,640,290.20 元, 该款项已于清算期内支付完毕。

(3) 本基金最后运作日应付管理费为人民币 362,636.83 元, 该款项已于清算期内支付完毕。

(4) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 96,703.17 元, 该款项已于清算期内支付完毕。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 292,662.49 元, 其中应付佣金 279,290.36 元、银行间交易费用 13,372.13 元, 上述费用均于清算期内支付完毕。

(6) 本基金最后运作日应交税费为人民币 19,321.11 元, 该款项已于清算期内支付完毕。

(7) 本基金最后运作日其他负债人民币 104,432.85 元, 其中预提信息披露费 58,849.83 元; 预提审计费 36,780.92 元, 另 16,780.92 元审计费于 2021 年 6 月 29 日进行回冲; 银行间账户维护费用 8,802.10 元, 另 497.90 元银行间费用于 2021 年 6 月 29 日补提, 上述费用均于清算期内支付完毕。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 6 月 29 日 (基金清算起始日) 至 2021 年 8 月 3 日 (基金清算结束日) 止期间
一、资产处置损益	-4,735.24
1. 利息收入	11,687.67
其中: 存款利息收入	11,687.67
债券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)	25,464,920.59
其中: 股票投资收益	25,467,611.17
债券投资收益	-
股利收益	-2,690.58
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	-25,481,343.50
4. 其他收入 (损失以“-”号填列)	-
二、清算费用	-85,088.31
1. 交易费用	-100,951.33

2. 其他费用	15,863.02
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	-89,823.55

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2021年6月28日基金净资产	503,452,720.23
加：清算期间净收益	-89,823.55
减：基金净赎回金额	- 456,640,290.20
二、2021年8月3日基金净资产	46,722,606.48

资产处置及负债清偿后，于2021年8月3日本基金剩余财产为人民币46,722,606.48元，根据《基金合同》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。

5.6 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，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- (1) 中金衡利1年定期开放债券型证券投资基金资产负债表及审计报告
- (2) 《中金衡利1年定期开放债券型证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 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。

中金衡利1年定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二一年八月六日