

富国中债1-5年国开行债券指数证券投资基金
清算报告

2021年9月10日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

公告日期：2021年9月30日

一、重要提示及目录

1、重要提示

富国中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金(以下简称“本基金”),系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]2119 号文准予注册募集,《富国中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)于 2020 年 04 月 13 日生效。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据市场环境变化,为更好地保护基金份额持有人的利益,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》和《基金合同》的有关规定,基金管理人经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,提议召开基金份额持有人大会审议终止基金合同。

富国中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金份额持有人大会已于 2021 年 7 月 29 日至 2021 年 8 月 27 日 17:00 以通讯方式召开基金份额持有人大会,对《关于终止富国中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》进行了投票表决,根据 2021 年 8 月 31 日的计票结果,本次会议议案获得通过,本次会议决议自 2021 年 8 月 31 日起生效。决议内容如下:

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》等法律法规的规定和《基金合同》有关约定,经基金管理人与基金托管人协商一致,并经基金份额持有人大会审议通过,同意终止《基金合同》。为实施终止本基金《基金合同》的方案,同意由基金管理人根据《基金合同》、《〈关于终止富国中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同有关事项的议案〉的说明》的相关内容组织基金财产清算小组对本基金财产实施清算并终止《基金合同》。

本次基金份额持有人大会决议生效后，根据基金份额持有人大会通过的议案及议案说明，本基金将自 2021 年 9 月 1 日起进入清算期。

本基金清算期自 2021 年 9 月 1 日起至 2021 年 9 月 10 日止。由基金管理人富国基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2021 年 9 月 1 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、目录

一、重要提示及目录	2
1、重要提示.....	2
2、目录.....	4
二、基金概况	5
三、财务会计报告	5
四、清盘事项说明	6
1、基金基本情况.....	6
2、清算原因.....	7
3、清算起始日.....	7
4、清算报表编制基础.....	7
五、清算情况	8
1、清算费用.....	8
2、资产处置情况.....	8
3、负债清偿情况.....	8
4、清算期间的清算损益情况.....	9
5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况.....	10
6、基金财产清算报告的告知安排.....	10
六、备查文件目录	10
1、备查文件目录.....	10
2、存放地点.....	11
3、查阅方式.....	11

二、基金概况

- 1、基金名称：富国中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金
- 2、基金简称：富国中债 1-5 年国开行债券基金（基金主代码：008350）。
- 3、基金运作方式：契约型、定期开放式
- 4、基金合同生效日：2020 年 04 月 13 日
- 6、基金管理人：富国基金管理有限公司
- 7、基金托管人：中国银行股份有限公司
- 8、最后运作日（2021 年 8 月 31 日）基金份额总额：1,781,257.77。
- 9、最后运作日（2020 年 8 月 31 日）基金资产净值：1,826,761.30 元。

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：富国中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 8 月 31 日

单位：人民币元

	最后运作日 2021 年 8 月 31 日
资产：	
银行存款	522,750.40
交易性金融资产	1,460,440.00
应收利息	4,921.04
资产总计	1,988,111.44
负债：	
应付管理人报酬	309.84
应付托管费	103.29
应付销售服务费	2.88
应付交易费用	841.38
其他负债	160,092.75

负债合计	161,350.14
所有者权益：	
实收基金	1,781,257.77
未分配利润	45,503.53
所有者权益合计	1,826,761.30
负债和所有者权益总计	1,988,111.44

四、清盘事项说明

1、基金基本情况

富国中债1-5年国开行债券指数证券投资基金，系经中国证监会证监许可[2019]2119号《关于准予富国中债1-5年国开行债券指数证券投资基金注册的批复》的准予注册，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2020年4月30日生效，首次设立募集规模为2,500,037,918.54份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围为本基金主要投资于标的指数的成份券及备选成份券。为更好地实现投资目标，基金还可投资于国内依法发行上市的政策性金融债、债券回购、银行存款。本基金不投资于股票，也不投资于除政策性金融债以外的债券资产。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；其中投资于待偿期1年至5年（包含1年和5年）的标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的80%；本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中债-1-5年国开行债券指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。自2020年4月13日至2021年8月31日期间，本基金按基

金合同约定正常运作。

2、清算原因

根据《富国中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》的“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的“二、基金合同的终止事由”的约定：

“有下列情形之一的，基金合同应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的；2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；3、基金合同约定的其他情形；4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

根据基金管理人 2021 年 8 月 31 日发布的《关于富国中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金基金份额持有人大会于 2021 年 7 月 29 日至 2021 年 8 月 27 日 17:00 以通讯方式召开基金份额持有人大会，对《关于终止富国中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》进行了投票表决，根据 2021 年 8 月 31 日的计票结果，该议案获得通过，基金份额持有人大会决议自该日起生效。

3、清算起始日

根据《关于富国中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自 2021 年 9 月 1 日起进入清算程序，故本基金清算起始日为 2021 年 9 月 1 日。

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》的有关规定编制的。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。

五、清算情况

自2021年9月1日至2021年9月10日止清算期间，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：

1、清算费用

按照《富国中债1-5年国开行债券指数证券投资基金》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财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币1,460,440.00元，已于2021年9月1日处置变现，结算金额（含债券应收利息总额）为人民币1,463,462.95元。

(2) 本基金最后运作日应收利息为人民币4,921.04元，其中应收银行存款利息人民币1,941.59元，应收银行间债券利息人民币2,979.45元，应收银行间债券利息人民币2,979.45元已于上述交易性金融资产卖出时收回，剩余款项将于2021年9月10日之后或下一个结息日划入托管账户。

3、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309.84元，该款项已于2021年9月2日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币103.29元，该款项已于2021年9月2日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币2.88元，该款项已于2021年9月2日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币841.38元，其中应付交易手续费人民币91.38元，应付结算服务费人民币750.00元，该款项将于2021年9月10日之后支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币160,092.75元。其中应付上清所查询费人民币300.00元，应付指数使用费人民币537.75元，应付银行汇划费人民币255.00元，应付银行间账户维护费人民币9,000.00元，应付2020年度财务报表审计费人民币70,000.00元，预提清算审计费人民币20,000.00元，应付2020年度信息披露费人民币60,000.00元。上述款项将于2021年9月10日之后支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2021年9月1日 至2021年9月10日 止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	193.10
2、处置交易性金融资产产生的净收益（注2）	43.50
清算收益小计	236.60
二、清算费用	
1、交易费用（注3）	153.63
2、其他费用（注4）	20.00
清算费用小计（注5）	173.63
三、清算净收益	62.97

注1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2021年9月1日至2021年9月10日止清算期间的银行存款利息。上述利息将于2021年9月10日之后或下一个结息日划入托管账户。

注2：处置交易性金融资产产生的净收益系清算期间卖出债券成交金额与应收债券利息减去卖出债券最后运作日的债券估值总额后的差额。

注3：交易费用系清算期间因处置交易性金融资产产生，该款项将于2021年9月10日之后支付。

注4：其他费用系清算期间因跨行转账产生，清算期间已支付其他费用人民币20.00

元

注5：除上述清算费用外的其他与本次清算相关的清算费用由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。

5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2021年8月31日基金净资产	1,826,761.30
加：清算期间净收益	62.97
减：基金净赎回转出金额 (于2021年9月1日确认的投资者赎回转出申请)	10.23
二、2021年9月10日基金净资产	1,826,814.04

根据本基金的基金合同，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。

资产处置及负债清偿后，本基金截至2021年9月10日止的剩余财产为人民币1,826,814.04 元。

截至2021年9月10日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币1,985,767.11元。

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，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 《富国中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 上海市通力律师事务所关于《富国中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金清算报告》的法律意见。

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

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。

富国中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金财产清算小组

2021 年 9 月 30 日