

中金新润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:中金基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告出具日期:2021年10月19日
报告公告日期:2021年10月21日

1 重要提示

中金新润3个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”或“中金新润3个月”)经中国证监会证监许可(2019)809号文注册,2020年1月21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工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

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;连续60个工作日出现前述情形的基金管理人应当提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。

在任一开放期的最后一日日终,有下列情形之一的,本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止基金合同,无需召开基金份额持有人大会:

- 1、基金份额持有人数量不满200人的;
 - 2、基金资产净值加上当日申购金额减去当日赎回金额后低于5000万。
- 法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。”

本基金第6个开放期自2021年9月23日(含该日)至2021年9月29日(含该日),共5个工作日。截至本次开放期的最后一日(2021年9月29日)日终(登记机构完成最后一日申购及转换转入、赎回及转出业务申请的确认以后),本基金基金资产净值低于5000万元,出现触发《基金合同》终止的上述情形,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9月30日起进入清算期,由基金管理人中金基金、基金托管人工商银行、毕马威华会计师事务所(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	中金新润3个月定期开放债券型证券投资基金
基金简称	中金新润3个月
基金主代码	007437
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020年1月21日
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
最后运作日(2021年9月29日)基金份额总额	565,453.45份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上,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	(一)封闭期投资策略。1.债券类属配置策略,根据不同债券板块之间的相对投资价值分析,确定债券类属配置策略,并根据市场变化及时进行调整。2.久期管理策略,在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益,在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下降的风险。3.收益率曲线策略,长、中、短期债券主要根据收益率曲线形状的变化进行合理配置,适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合并动态调整。4.信用债券投资策略,主要通过买入并持有信用风险可承担、期限与收益率相对合理的信用债券产品,获取票息收益。5.资产支持证券投资策略,重点关注标的证券发行条款、基础资产的类型,预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响,加强对未来现金流稳定性的分析。6.信用衍生品投资策略,结合账户内债券潜在信用风险、流动性等情况综合考量,通过购买对应信用衍生品全部或部分覆盖配置相应债券的信用风险。(二)开放期投资策略,主要投资于具有较高流动性的投资品种,通过合理配置组合期限结构等方式,积极防范流动性风险,在满足组合流动性需求的同时,尽量减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金,低于股票型基金和混合型基金。

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:中金新润3个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2021年9月29日(基金最后运作日)

单位:人民币

资产	本期末2021年9月29日 (基金最后运作日)
资产:	-
银行存款	327,309.53
结算备付金	195,910.42
存出保证金	485.76
交易性金融资产	-
其中:股票投资	-
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	1,740.95
应收股利	-
应收申购款	116,382.55
递延所得税资产	-
其他资产	-

资产总计	641,829.21
负债和所有者权益	本期末2021年9月29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	30.90
应付管理人报酬	10,745.98
应付托管费	3,582.00
应付销售服务费	5.89
应付交易费用	925.52
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	34,983.70
负债合计	50,273.99
所有者权益:	-
实收基金	565,453.45
未分配利润	26,101.77
所有者权益合计	591,555.22
负债和所有者权益总计	641,829.21

注:报告截止日2021年9月29日(基金最后运作日),中金新润3个月A基金份额净值1.0513元,基金份额总额313,172.69份;中金新润3个月C基金份额净值1.0397元,基金份额总额252,280.76份,总份额合计565,453.45份。

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

中金新润3个月定期开放债券型证券投资基金依据中国证监会于2019年4月19日证监许可(2019)809号《关于准予中金新润3个月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》、《中金新润3个月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》)、《中金新润3个月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《中金新润3个月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。本基金为定期开放式债券型基金,存续期限为不定期。本基金的基金管理人为中金基金,基金托管人为工商银行。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台共同销售,募集期为2019年10月17日起至2020年1月16日。经向中国证监会备案,《中金新润3个月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1月21日正式生效,基金合同生效日基金实收份额为201,049,463.92份(含利息转份额10,878.76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《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《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,包括国内依法发行上市的债券(包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等)、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、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)。本基金不直接投资股票等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

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;连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。

在任一开放期的最后一日日终,有下列情形之一的,本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止基金合同,无需召开基金份额持有人大会:

1. 基金份额持有人数量不满200人的;
2. 基金资产净值加上当日申购金额减去当日赎回金额后低于5000万。

法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。”

本基金第6个开放期自2021年9月23日(含该日)至2021年9月29日(含该日),共5个工作日。截至本次开放期的最后一日(2021年9月29日)日终(登记机构完成最后一日申购及转换转入、赎回及转换转出业务申请的确认以后),本基金基金资产净值低于5000万元,出现触发《基金合同》终止的上述情形,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9月30日起进入清算期,清算期为2021年9月30日至2021年10月12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。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9月30日至2021年10月12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

金剩余财产中支付。

5.2 资产处置情况

银行存款、备付金、保证金及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	清算期末账面价值
1	银行存款	327,309.53	136,714.24	464,023.77
2	结算备付金	195,910.42	26,589.58	222,500.00
3	存出保证金	485.76	-485.76	0.00
4	应收利息	1,740.95	176.79	1,917.74
5	应收申购款	116,382.55	-116,382.55	0.00

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30.90元,该款项已于2021年9月30日支付完毕。

(2) 本基金自2021年9月30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9月30日确认2021年9月29日的赎回申请金额为人民币186.79元、申购申请金额为97,265.59元,上述款项均于2021年10月8日交收完毕。

(3) 本基金最后运作日应付管理费为人民币10,745.98元,该款项已于2021年10月11日支付。

(4) 本基金最后运作日应付托管费为人民币3,582.00元,该款项已于2021年10月11日支付。

(5) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币5.89元,该款项已于2021年10月11日支付。

(6) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币925.52元,该款项已于2021年10月11日支付。

(7) 本基金最后运作日其他负债人民币34,983.70元,其中预提审计费26,082.08元,另6,082.08元审计费于2021年9月30日进行回冲;预提账户维护费8,901.62元,另98.38元账户维护费于2021年9月30日补提;上述费用均于清算期支付完毕。

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9月30日(基金清算起始日)至2021年10月12日 (基金清算结束日)止期间
一、资产处置损益	176.79
1.利息收入	176.79
其中:存款利息收入	176.79
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)	-
其中:股票投资收益	-
债券投资收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-
4.其他收入(损失以“-”号填列)	-
二、清算费用	-404.30
1.交易费用	-
2.其他费用	-404.30
三、清算净损益(净亏损以“-”号填列)	-227.51

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9月29日基金净资产	591,555.22
加:清算期间净收益	-227.51
减:基金净赎回金额	-97,078.80
二、2021年10月12日基金净资产	688,406.51

资产处置及负债清偿后,于2021年10月12日本基金剩余财产为人民币688,406.51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。

自本次清算期结束日次日2021年10月13日至清算款项支付日前一日的存款利息归基金份额持有人所有。

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) 中金新润3个月定期开放债券型证券投资基金审计报告

(2) 《中金新润3个月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。

中金新润3个月定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二一年十月二十一日

