

中海瑞利六个月定期开放债券型证券投资基金  
清算报告

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

清算报告出具日：2021年5月7日

清算报告公告日：2021年6月21日

## 一、重要提示

中海瑞利六个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由中海惠利纯债分级债券型证券投资基金转型而来。中海惠利纯债分级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”）2013年8月13日证监许可[2013]1083号文准予募集注册，自2013年11月21日起《中海惠利纯债分级债券型证券投资基金基金合同》生效，基金管理人为中海基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据中国证监会证监许可[2019]1399号《关于准予中海惠利纯债分级债券型证券投资基金变更注册的批复》及本基金的基金管理人中海基金管理有限公司于2019年9月18日发布的《关于中海惠利纯债分级债券型证券投资基金份额持有人大会决议生效的公告》，投票时间自2019年8月23日起至2019年9月16日17:00止，以通讯方式召开的基金份额持有人大会审议通过了《关于中海惠利纯债分级债券型证券投资基金转型相关事项的议案》。经与基金托管人协商一致，基金管理人已将《中海惠利纯债分级债券型证券投资基金基金合同》修订为《中海瑞利六个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》，《中海瑞利六个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》自2019年10月24日起生效，原《中海惠利纯债分级债券型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

根据《中海瑞利六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”）约定，连续60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，基金管理人应当按照基金合同约定的程序进行清算并直接终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会审议。截至2021年3月16日日终，本基金已出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，本基金将根据基金合同约定进入清算程序，无需召开基金份额持有人大会进行表决。自2021年3月17日起，本基金进入基金财产清算程序。本基金最后运作日为2021年3月16日。基金管理人已就该事项于2021年1月7日、2021年1月20日、2021年3月2日、2021年3月9日和2021年3月16日在《中国证券报》及基金管理人网站分别刊登了《中海基金管理有限公司关于中海瑞利六个月定期开放债券型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告》、《中海基金管理有

限公司关于中海瑞利六个月定期开放债券型证券投资基金触发基金合同终止情形的提示性公告》和《中海基金管理有限公司关于中海瑞利六个月定期开放债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

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）和上海市通力律师事务所于2021年3月17日成立基金财产清算小组，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，上海市通力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    | 中海瑞利六个月定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称    | 中海瑞利六个月定期开放债券        |
| 基金主代码   | 000316               |
| 基金运作方式  | 契约型、定期开放式            |
| 基金合同生效日 | 2019年10月24日          |
| 基金管理人   | 中海基金管理有限公司           |
| 基金托管人   | 招商银行股份有限公司           |
| 基金合同存续期 | 不定期                  |

## 三、 基金运作情况

中海惠利纯债分级债券型证券投资基金经中国证监会2013年8月13日证监许可【2013】1083号文准予募集注册，由基金管理人依照法律法规、《中海惠利纯债分级债券型证券投资基金基金合同》等规定于2013年10月17日至2013年11月18日期间向社会公开募集。《中海惠利纯债分级债券型证券投资基金基金合同》于2013年11月21日正式生效，《中海惠利纯债分级债券型证券投资基金基金合同》生效日的基金份额总数为2,327,600,061.66份（含募集期间利息结转的份额）。中海惠利纯债分级债券型证券投资基金自成立（2013年11月21日）至2019年10月24日期间，按《中海惠利纯债分级债券型证券投资基金基金合同》约定正常运作。本基金由中海惠利纯债分级债券型证券投资基金转型而来，本基金基金合同自2019年10月24日起生效，自2019年10月24日起至2021年3月16日（本基金最后运作日）期间，按基金合同约定正常运作。

根据基金合同的有关约定，连续60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，基金管理人应当按照基金合同约

定的程序进行清算并直接终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会审议。截至2021年3月16日日终，本基金已出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，本基金将根据基金合同约定进入清算程序，无需召开基金份额持有人大会进行表决。本基金自2021年3月17日起进入基金财产清算程序，不再开放办理申购、赎回等业务。基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

## 四、 财务会计报告

(一) 中海瑞利六个月定期开放债券型证券投资基金最后运作日资产负债表

单位：人民币元

|                    | 最后运作日<br>2021年3月16日 |
|--------------------|---------------------|
| <b>资 产</b>         |                     |
| 银行存款               | 5,272,287.71        |
| 结算备付金              | 34,081.33           |
| 存出保证金              | 18,017.19           |
| 应收利息               | 1,479.92            |
| <b>资产合计：</b>       | <b>5,325,866.15</b> |
| <b>负 债</b>         |                     |
| 应付管理人报酬            | 1,385.70            |
| 应付托管费              | 346.43              |
| 应付交易费用             | 1,782.36            |
| 其他应付款              | 9,300.00            |
| 预提费用               | 45,000.00           |
| <b>负债合计：</b>       | <b>57,814.49</b>    |
| <b>所有者权益</b>       |                     |
| 实收基金               | 4,634,210.72        |
| 未分配利润              | 633,840.94          |
| <b>所有者权益合计：</b>    | <b>5,268,051.66</b> |
| <b>负债与持有人权益总计：</b> | <b>5,325,866.15</b> |

## 五、 清算情况

自2021年3月17日至2021年5月7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、资产处置情况

- (1) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 18,017.19 元，该款项已于 2021 年 4 月 2 日划入托管账户。
- (2) 本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 34,081.33 元，由于中登结算制度影响，结算备付金于 2021 年 4 月 2 日调整为人民币 43,128.82 元，上调金额人民币 9,047.49 元已于 2021 年 4 月 2 日从托管户划出。调整后的结算备付金人民币 43,128.82 元已于 2021 年 5 月 7 日划入托管账户。
- (3) 本基金最后运作日应收利息为人民币 1,479.92 元，其中应收银行存款利息人民币 165.71 元，已于 2021 年 3 月 21 日划入托管账户；应收结算备付金利息人民币 1,240.07 元、应收存出保证金利息人民币 74.14 元，已于 2021 年 3 月 22 日划入托管账户。

## 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 1,385.70 元，该款项已于 2021 年 4 月 6 日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 346.43 元，该款项已于 2021 年 4 月 6 日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 1,782.36 元，该款项已于 2021 年 4 月 15 日支付。
- (4) 本基金最后运作日其他应付款为人民币 9,300.00 元，该款项为账户维护费及查询服务费，已于 2021 年 4 月 15 日支付。
- (5) 本基金最后运作日预提费用为人民币 45,000.00 元，该款项为预提审计费，已于 2021 年 4 月 30 日支付。

## 3、清算期间的清算损益情况

| 项目         | 自2021年3月17日<br>至2021年5月7日<br>止清算期间<br>金额（单位：人民币元） |
|------------|---|
| 一、收益       |   |
| 1、利息收入（注1） | 2,769.07  |
| 收益小计       | 2,769.07  |
| 二、费用（注2）   |   |

|           |          |
|-----------|----------|
| 1、银行划款手续费 | 50.00    |
| 费用小计      | 50.00    |
| 三、清算期间净收益 | 2,719.07 |

注1：利息收入系计提的自2021年3月17日至2021年5月7日止清算期间的银行存款利息、存出保证金利息、结算备付金利息。

注2：本基金清算期间的审计费、律师费由基金管理人承担。

#### 4、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

| 项目                           | 金额（单位：人民币元）  |
|------------------------------|--------------|
| 一、最后运作日 2021 年 3 月 16 日基金净资产 | 5,268,051.66 |
| 加：清算期间净收益                    | 2,719.07     |
| 加：清算期间收到申购款                  | -            |
| 减：清算期间支付赎回款                  | -            |
| 二、2021 年 5 月 7 日基金净资产        | 5,270,770.73 |

处置及负债清偿后，本基金于2021年5月7日剩余财产为人民币5,270,770.73元，根据本基金的基金合同约定，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。

清算起始日2021年3月17日至清算款划出日前一日的银行存款利息、存出保证金利息和结算备付金利息均属基金份额持有人所有，后续产生的各类划付手续费由投资者承担。尚未结息的利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

## 六、 备查文件

### （一） 备查文件目录

- 1、《中海瑞利六个月定期开放债券型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《中海瑞利六个月定期开放债券型证券投资基金清算报告》的法律意见。

### （二） 存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

### （二） 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

中海瑞利六个月定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组  
二〇二一年六月二十一日