

国金基金管理有限公司
国金量化添利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：国金基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

清算报告出具日期：2021年11月17日

清算报告公告日期：2021年11月30日

一、重要提示

国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）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【2018】1033号文准予注册募集，于2018年11月2日正式运作，基金管理人为国金基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为兴业银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”或“兴业银行”）。

根据《国金量化添利定期开放债券型发起式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“四、基金的终止”的约定：“基金合同生效之日起三年后的年度对应日，若基金资产净值低于2亿元的，基金合同自动终止，不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。”基金合同生效之日起三年后的年度对应日为2021年11月2日，截至2021年11月2日日终，本基金基金资产净值低于2亿元，触发基金合同约定的终止条件，本基金将根据基金合同约定进入基金财产清算程序，不需召开基金份额持有人大会。

本基金自2021年11月3日起进入清算程序，由基金管理人、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11月3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，由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	国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	国金量化添利
基金代码	006189
基金运作方式	契约型开放式，并采用定期开放方式运作
基金合同生效日	2018年11月2日
基金最后运作日（2021年11月2日）基金份额总额	107,589,252.15份
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益。
主要投资策略	<p>1、封闭期投资策略</p> <p>（1）债券投资策略</p> <p>在债券投资方面，基金管理人将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。</p> <p>（2）股票投资策略</p> <p>本基金股票部分以“量化投资”为主要投资策略，“阿尔法多因子选股模型”进行股票选择并据此构建股票投资组合。在实际运行过程中将定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p>
业绩比较基准	中债总全价指数收益率×80%+中证500指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

三、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2018】1033 号文准予注册募集，由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定自 2018 年 10 月 15 日至 2018 年 10 月 26 日止向社会公开发行人募集，本基金基金合同于 2018 年 11 月 2 日正式生效。基金合同生效日的基金总份额（含利息结转的份额）为 150,011,600.00 份。自 2018 年 11 月 2 日至 2021 年 11 月 2 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

根据《基金合同》约定，本基金合同生效之日起三年后的年度对应日为 2021 年 11 月 2 日，截至 2021 年 11 月 2 日日终，本基金基金资产净值低于 2 亿元，触发基金合同约定的终止条件，本基金将根据基金合同约定进入基金财产清算程序，不需召开基金份额持有人大会。本基金自 2021 年 11 月 3 日起进入清算期。

四、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年11月2日

单位：人民币元

	最后运作日 2021年11月2日
资产：	
银行存款	73,266,245.02
结算备付金	1,405,945.09
应收证券清算款	39,049,700.42
应收利息	3,981.11
资产总计	113,725,871.64
负债：	
应付管理人报酬	4,688.33
应付托管费	937.66
应付交易费用	5,092.50
应交税费	3,835.24
其他负债	118,831.68
负债合计	133,385.41
所有者权益：	
实收基金	107,589,252.15
未分配利润	6,003,234.08
所有者权益合计	113,592,486.23
负债和所有者权益总计	113,725,871.64

注：1、本基金最后运作日2021年11月2日，基金份额总额为107,589,252.15份，基金资产净值为113,592,486.23元，本基金单位净值为1.0558元。

2、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 11 月 3 日起至 2021 年 11 月 17 日止为清算期间，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：

（一）清算费用

根据《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”的约定：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。

（二）资产处置情况

1、 本基金最后运作日结算备付金为人民币 1,405,945.09 元，该款项由基金管理人在 2021 年 11 月 17 日以自有资金垫付至托管账户；

2、 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 39,049,700.42 元，已于 2021 年 11 月 3 日划入托管账户；

3、 本基金最后运作日应收利息为人民币 3,981.11 元，其中银行活期存款应收利息为人民币 1,666.10 元，应收清算备付金利息为人民币 2,250.01 元，应收存出保证金利息为人民币 65.00 元。清算期间银行活期存款产生的应收利息为人民币 16,360.42 元，清算备付金产生的应收利息为人民币 949.05 元。截至清算期结束日应收利息余额为人民币 21,290.58 元，该款项由基金管理人在 2021 年 11 月 17 日以自有资金垫付至托管账户。

（三）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 4,688.33 元，已于清算期内支付；

2、 本基金最后运作日应付托管费为人民币 937.66 元，已于清算期内支付；

3、 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 5,092.50 元，已于清算期内支付；

4、 本基金最后运作日应交税费为人民币 3,835.24 元，已于清算期内支付；

5、 本基金最后运作日其他负债为人民币 118,831.68 元，其中预提审计费人民币 15,000.00 元，预提信息披露费人民币 100,603.62 元，预提债券账户维护费人民币 3,228.06 元，已于清算期内支付。清算期间发生预提律师费人民币

20,000.00 元，发生预提债券账户维护费人民币 2,971.94 元，已于清算期内支付。

（四）清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2021 年 11 月 3 日 至 2021 年 11 月 17 日 止清算期间
一、清算期间收益	
利息收入（注 1）	17,309.47
清算收益小计	17,309.47
二、清算期间费用	
清算律师费	20,000.00
交易费用	2,971.94
银行手续费（注 2）	307.81
清算费用小计	23,279.75
三、清算期间净损失	-5,970.28

注1：利息收入系计提的清算期间的银行活期存款、结算备付金利息。

注 2：银行手续费系清算期间发生的和预提的将基金剩余财产分配给基金份额持有人的银行划付手续费。

（五）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
最后运作日 2021 年 11 月 2 日基金净资产	113,592,486.23
加：清算期间净损失	-5,970.28
减：基金净赎回金额	-
2021 年 11 月 17 日净资产	113,586,515.95

截至本次清算期结束日 2021 年 11 月 17 日，本基金剩余财产为人民币 113,586,515.95 元。自本次清算期结束日次日 2021 年 11 月 18 日至清算款分配划出日前一日的银行存款等产生的利息归份额持有人所有，按实际适用的利率计算，由基金管理人以自有资金垫付并于清算款划出前划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

（六）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。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配剩余财产。

六、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金清算审计报告》
- 2、《上海市通力律师事务所关于<国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金清算报告>的法律意见》

（二）存放地点

基金管理人的办公场所。

（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。

国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

2021年11月17日

《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金清算报告》签署页

基金管理人：国金基金管理有限公司（盖章）

基金托管人：兴业银行股份有限公司（盖章）