

民生加银润利混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：渤海银行股份有限公司

报告出具日期：2021年12月10日

报告送出日期：2021年12月23日

一、重要提示

民生加银润利混合型证券投资基金（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[2020]2513】号文注册，于2021年4月27日成立并正式运作，基金管理人为民生加银基金管理有限公司，基金托管人为渤海银行股份有限公司。

依据《民生加银润利混合型证券投资基金基金合同》“第五部分 基金备案”的“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”中的约定：“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，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

本基金基金份额持有人大会于2021年11月29日表决通过了《关于民生加银润利混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》，于2021年11月30日在规定媒介就本基金基金合同终止及进行基金财产清算的事宜进行了公告，详见《民生加银润利混合型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》。

本基金于2021年12月1日起进入清算程序，由本基金管理人民生加银基金管理有限公司、基金托管人渤海银行股份有限公司、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。

二、基金概况

| | |
|-------------------|---|
| 基金名称 | 民生加银润利混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 民生加银润利混合 |
| 基金主代码 | 010921 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021年4月27日 |
| 2021年11月30日基金份额总额 | 25,017,353.21份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险的基础上，通过对固定收益类品种的积极投资，追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金通过对宏观经济、财政政策、货币政策、市场利率以及各行业等方面的深入、系统、科学的研究，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略，在严格控制风险和保持充足流动性的基础上，动态调整资产配置比例，力求 |

| | |
|--------|--|
| | 最大限度降低投资组合的波动性，力争获取持续稳定的绝对收益。 |
| 业绩比较基准 | 中债总指数收益率×80%+一年期定期存款基准利率(税后)×5%+沪深 300 指数收益率×15% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 |
| 基金管理人 | 民生加银基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 渤海银行股份有限公司 |

三、基金运作情况概述

1、基本情况

民生加银润利混合型证券投资基金（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”）2020年10月9日证监许可[2020]2513号文《关于准予民生加银润利混合型证券投资基金注册的批复》注册。本基金由民生加银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《民生加银润利混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）发售，《基金合同》于2021年4月27日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为204,516,464.12份基金份额。本基金的基金管理人为民生加银基金管理有限公司，基金托管人为渤海银行股份有限公司（以下简称“渤海银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《民生加银润利混合型证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《民生加银润利混合型证券投资基金更新招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要包括股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票等）、存托凭证、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、国内依法发行上市的衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权）、银行存款、同业存单、现金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的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的0-30%，投资于同业存单的比例不超过基金资产的20%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：

中债总指数收益率×80%+一年期定期存款基准利率（税后）×5%+沪深300指数收益率×15%。

2、清算原因

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“二、《基金合同》的终止事由”中的约定，“有下列情形之一的，经履行相关程序后，《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。”民生加银润利混合型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，会议投票表决时间为2021年10月29日起至2021年11月26日止。本基金基金份额持有人大会于2021年11月29日表决通过了《关于民生加银润利混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》，该决议于2021年11月29日生效，并于2021年11月30日在规定媒介就本基金基金合同终止及进行基金财产清算的事宜进行了公告，详见《民生加银润利混合型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》。

3、清算起始日

根据基金管理人于2021年11月30日刊登的《民生加银润利混合型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》，本基金最后运作日为2021年11月30日，于2021年12月1日本基金进入清算程序，故本基金清算起始日为2021年12月1日。清算期间为自2021年12月1日（清算起始日）至2021年12月10日（清算结束日）止期间。

四、 财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：民生加银润利混合型证券投资基金

报告截止日：2021年11月30日

单位：人民币元

| | 2021年11月30日 (最后运作日) |
|---------|------------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 20,586,349.00 |
| 结算备付金 | 46,104.12 |
| 存出保证金 | 112,359.72 |
| 交易性金融资产 | 3,963,905.50 |
| 其中：股票投资 | 1,891,870.00 |
| 债券投资 | 2,072,035.50 |
| 应收利息 | 46,189.96 |
| 资产合计 | 24,754,908.30 |
| 负债： | |

| | |
|------------|---------------|
| 应付管理人报酬 | 12,593.58 |
| 应付托管费 | 2,098.94 |
| 应付交易费用 | 12,287.45 |
| 其他负债 | 80,000.00 |
| 负债合计 | 106,979.97 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 25,017,353.21 |
| 未分配利润 | -369,424.88 |
| 所有者权益合计 | 24,647,928.33 |
| 负债与持有人权益总计 | 24,754,908.30 |

注 1：于最后运作日 2021 年 11 月 30 日，基金份额总额 25,017,353.21 份，份额净值人民币 0.9852 元，资产净值为 24,647,928.33 元。

注 2：本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。本基金已将账面价值高于预计可收回金额的资产调整至预计可收回金额，并按预计结算金额计量负债。同时，不对资产、负债进行流动与非流动的划分。由于报告性质所致，本清算报表只列示最后运作日 2021 年 11 月 30 日的资产负债表，不列示比较数据。

五、 清算情况

本基金的资产、负债及于清算期间的具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《民生加银润利混合型证券投资基金基金合同》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。

2、 资产处置情况

(1)本基金于 2021 年 11 月 30 日（最后运作日）银行存款为人民币 20,586,349.00 元，是存储于基金托管人渤海银行的活期银行存款。

(2)本基金于 2021 年 11 月 30 日（最后运作日）结算备付金为人民币 46,104.12 元，存出保证金为人民币 112,359.72 元，截至 2021 年 12 月 10 日（清算结束日）结算备付金及存出保证金已划入基金托管账户。

(3)本基金于 2021 年 11 月 30 日（最后运作日）应收利息账面价值为人民币 46,189.96 元。已每日计息，预计 2021 年 12 月 21 日结息日收到该款项。

(4)本基金于 2021 年 11 月 30 日（最后运作日）持有的交易性金融资产账面价值为人民币 3,963,905.50 元，交易性金融资产为股票投资及债券投资，截至 2021 年 12 月 10 日，本基金持有的交易性金融资产已全部变现完毕。

3、 负债清偿情况

(1)本基金于 2021 年 11 月 30 日（最后运作日）应付管理人报酬为人民币 12,593.58 元。该款

项已于 2021 年 12 月 3 日支付完毕。

(2)本基金于 2021 年 11 月 30 日（最后运作日）应付托管费为人民币 2,098.94 元。该款项已于 2021 年 12 月 3 日支付完毕。

(3)本基金于 2021 年 11 月 30 日（最后运作日）应付交易费用为人民币 12,287.45 元。该款项已于 2021 年 12 月 9 日支付完毕。

(4)本基金于 2021 年 11 月 30 日（最后运作日）其他负债为人民币 80,000.00 元，为律师费、审计费、公证费。其中，律师费为人民币 60,000.00 元，该款项将于收到律师所付费通知书后支付；审计费为人民币 10,000.00 元，该款项将于收到审计所付费通知书后支付；公证费为人民币 10,000.00 元，该款项已于 2021 年 12 月 2 日支付完毕。

4、 清算期间的清算损益情况及剩余财产分配情况

| | 单位：人民币元 |
|--------------------------------|---------------|
| 一、2021 年 11 月 30 日（最后运作日）基金净资产 | 24,647,928.33 |
| 加：清算期间收益（损失以“-”填列）： | |
| 利息收入（注 1） | 5,533.62 |
| 投资收益（注 2） | 42,317.43 |
| 公允价值变动损失（注 3） | -34,491.87 |
| 减：清算期间费用： | |
| 交易费用（注 4） | 3,445.76 |
| 二、2021 年 12 月 10 日（清算结束日）基金净资产 | 24,657,841.75 |

注 1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2021 年 12 月 1 日（清算起始日）至 2021 年 12 月 10 日（清算结束日）止期间的银行存款利息收入、债券利息收入、结算备付金利息收入及存出保证金利息收入；

注 2：投资收益系以当前适用的利率预估计提的自 2021 年 12 月 1 日（清算起始日）至 2021 年 12 月 10 日（清算结束日）止期间的股票投资收益及债券投资收益；

注 3：公允价值变动损失系清算期间的公允价值变动损失；

注 4：交易费用为清算期间的交易所市场交易费用。

资产处置及负债清偿后，于 2021 年 12 月 10 日（清算结束日）本基金剩余净资产为人民币 24,657,841.75 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。

2021 年 12 月 11 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属基金份额持有人所有。

六、 备查文件

1、 备查文件目录

(1) 民生加银润利混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告

(2) 民生加银润利混合型证券投资基金财产清算的法律意见

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

民生加银润利混合型证券投资基金基金财产清算小组

2021年12月10日