

# 宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金清算报告

基金管理人:宝盈基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
清算报告出具日:二〇二二年二月二十一日  
清算报告公告日:二〇二二年二月二十二日

## 一、重要提示

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》、《宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,《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 50 个工作日出现前述情形的,《基金合同》将终止并进行基金财产清算,且无需召开持有人大会,同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。

截至 2022 年 1 月 25 日日终,宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)已连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元,触发了《基金合同》终止的情形。宝盈基金管理有限公司自 2022 年 1 月 26 日起根据相关法律法规、《基金合同》等规定履行基金财产清算程序。

本基金自 2022 年 1 月 26 日起进入清算期,由基金管理人宝盈基金管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰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,并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二、基金概况

### 1、基金基本情况

基金名称	宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金	
基金简称	宝盈盈辉纯债	
基金主代码	009282	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 5 月 21 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
基金最后运作日基金份额总额(运作日后有赎回确认)	10,897,151.35 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	宝盈盈辉纯债 A	宝盈盈辉纯债 C
下属分级基金的交易代码	009282	009283
基金最后运作日下属分级基金的份额总额	10,892,497.99 份	4,653.36 份

### 2、基金产品说明

投资目标	本基金将在严格控制投资组合风险的前提下,谋求基金资产的长期、稳定增值,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<b>1. 债券投资策略</b> 本基金以宏观研究、行业研究、公司研究三个维度为决策出发点,结合估值研究、投资者行为研究,自上而下确定组合整体杠杆率以及货币类、利率类、信用类的债券配置比例。同时,本基金注重微观层面的投资研究及策略,尤其是在信用债券领域,具体投资标的选取和估值评估侧重深入的自下而上研究。 本基金采用的投资策略主要包括债券资产配置策略、行业配置策略、公司配置策略、流动性管理策略。 <b>2. 资产支持证券投资策略</b> 本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析、公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×90%+1 年期定期存款利率(税后)×10%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金,其预期收益和预期风险水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

### 三、基金运作情况概述

宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金经 2020 年 3 月 19 日中国证券监督管理委员会证监许可[2020]458 号《关于准予宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金注册的批复》准予募集注册。本基金自 2020 年 5 月 15 日起向社会公开募集,基金募集工作于 2020 年 5 月 18 日顺利结束。本次募集净认购金额为 200,105,583.90 元人民币,有效认购户数为 278 户。上述资金于 2020 年 5 月 19 日全额划入本基金在基金托管人兴业银行股份有限公司开立的宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金托管专户。经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验资并向中国证监会备案,《宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 21 日正式生效。

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》、《宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金出现了《基金合同》约定的终止事由。基金管理人宝盈基金管理有限公司经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致后,决定根据《基金合同》的规定履行基金财产清算程序。本基金最后运作日为 2022 年 1 月 25 日,本基金自 2022 年 1 月 26 日起进入基金财产清算程序。

### 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:宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金

报告截止日:2022 年 1 月 25 日(基金最后运作日)

单位:人民币元

资产:	2022年1月25日(基金最后运作日)
银行存款	828,939.19
结算备付金	153.45
存出保证金	1,228.21
交易性金融资产	10,245,000.00
其中:交易性债券投资	10,245,000.00
资产合计:	11,075,320.85
负债和所有者权益	2022年1月25日(基金最后运作日)
负债:	
应付管理人报酬	2,654.92
应付托管费	884.96
应付销售服务费	1.62
其他负债	33,119.80
负债合计:	36,661.30
所有者权益:	
实收基金	10,897,151.35
未分配利润	141,508.20
所有者权益合计:	11,038,659.55
负债和所有者权益总计:	11,075,320.85

注:报告截止日2022年1月25日(基金最后运作日),基金份额总额为10,897,151.35份;其中宝盈盈辉纯债A基金份额总额10,892,497.99份,基金份额净值1.0130元;宝盈盈辉纯债C基金份额总额4,653.36份,基金份额净值0.8775元。

#### 五、清算情况

自2022年1月26日至2022年2月17日止的清算期间,基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算,具体清算情况如下:

##### 1、清算费用

按照《宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金基金合同》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)本基金最后运作日的银行存款为人民币828,939.19元,其中827,928.24元为存储于基金托管人兴业银行股份有限公司的活期银行存款,1,010.95元为应计活期银行存款利息;

(2)本基金最后运作日结算备付金为人民币153.45元,为应计上海证券交易所最低结算备付金利息;

(3)本基金最后运作日存出保证金为人民币1,228.21元,其中1,226.20元为由中国证券登记结算有限责任公司收取并保管的存出保证金,于2022年2月8日转入本基金托管户,2.01元为应计上海证券交易所存出保证金利息;

(4)本基金最后运作日交易性债券投资为人民币10,245,000.00元,包含应计利息人民币245,000.00元,该债券于2022年1月26日到期兑付,兑付金额为人民币10,245,000.00元。

##### 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2,654.92元,该款项已于2022年2月9日支付;

(2)本基金最后运作日应付托管费为人民币884.96元,该款项已于2022年2月9日支付;

(3)本基金最后运作日应付销售服务费为人民币1.62元,该款项已于2022年2月9日支付;

(4)本基金最后运作日其他负债为人民币33,119.80元,其中:

应付审计费为人民币31,369.75元(归属于2021年的审计费为人民币30,000.00元),该款项将于实际支付时扣除;

应付中债登账户维护费为人民币1,500.00元,该款项已于2022年2月8日支付;

应付银行汇划费为人民币250.05元,该款项已于2022年2月7日支付。

##### 4、清算期间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2022年1月25日基金净资产	11,038,659.55
加:清算期间(2022年1月26日至2022年2月17日)收入	1,453.02
其中:利息收入-银行存款利息收入(注1)	1,452.24
利息收入-存出保证金利息收入(注1)	0.78
减:清算期间(2022年1月26日至2022年2月17日)应付款项	5,013,055.87
其中:基金份额赎回产生的基金净值变动(注2)	5,012,855.87
银行汇划手续费(注3)	200.00
二、清算结束日(2022年2月17日)基金资产净值(注4)	6,027,056.70

注1:利息收入系以当前适用利率预估,该金额可能与实际结息金额存在略微差异。

注2:本基金最后运作日为2022年1月25日,基金份额持有人在该日提交的有效赎回申请,基金管理人于2022年1月26日对其所申请的赎回份额进行确认并在2022年1月28日支付赎回款。

注3:银行汇划手续费为清算期间本基金托管账户的预估银行汇划费。

注4:资产处置及负债清偿后,截至2022年2月17日本基金剩余财产为人民币6,027,056.70元,根据本基金《基金合同》的约定,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。清算期结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款孳生的利息归基金份额持有人所有。

为保护基金份额持有人利益,加快清盘速度,基金管理人可以在清算付款日以自有资金先行垫付上述未结息金额,供清盘分配使用,待实际资金到账后再返还基金管理人,基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有,利息收入和汇划手续费的预估金额与实际结算金额的差额由基金管理人承担。

##### 5、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,报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

##### 六、备查文件

###### 1、备查文件目录

(1)《宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金清算审计报告》

(2)《上海源泰律师事务所关于宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金清算事宜之法律意见》

###### 2、存放地点

基金管理人的住所和/或办公场所。

###### 3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的住所和/或办公场所或在基金管理人网站免费查阅。

宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金财产清算小组

2022年2月21日(清算报告出具日期)