

国金基金管理有限公司国金惠宁中短期利率债债券型证券 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：浙商银行股份有限公司

清算报告出具日期：2022年9月20日

清算报告公告日期：2022年9月24日

一、重要提示

国金惠宁中短期利率债债券型证券投资基金（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】2548号文准予注册募集，于2020年12月23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”），基金托管人为浙商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”或“浙商银行”）。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人利益，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》和《国金惠宁中短期利率债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）等有关规定，本基金管理人经与基金托管人协商一致，于2022年7月14日发布《关于以通讯方式召开国金惠宁中短期利率债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，审议《关于终止国金惠宁中短期利率债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本基金份额持有人大会投票表决起止时间自2022年7月15日起，至2022年8月16日15:00止。本次会议议案于2022年8月17日有效通过，大会决议自通过之日起生效，本基金管理人于2022年8月18日发布《关于国金惠宁中短期利率债债券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》。本基金自2022年8月19日起进入清算程序。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2022年8月19日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，出具清算报告，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。

1

二、基金概况

基金名称 国金惠宁中短期利率债债券型证券投资基金

基金简称 国金惠宁中短期利率债

基金代码 010498

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2020年12月23日

基金最后运作日（2022年8月1

8日）基金份额总额 179,672.24份

投资目标

本基金通过研判债券市场的收益率变化，在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。

主要投资策略

1、 债券投资策略

（1）久期管理策略

（2）期限结构配置策略

（3）骑乘策略

（4）息差策略

2、 流动性管理策略

业绩比较基准 中债-总财富（1-3年）指数收益率*90%+人民币活期存款收益率（税后）*10%

风险收益特征 本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

基金管理人 国金基金管理有限公司

基金托管人 浙商银行股份有限公司

下属基金类别的基金简称 国金惠宁中短期利率债 A 国金惠宁中短期利率债 C

下属基金类别的交易代码 010498 010499

2

三、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2020】2548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2020年12月7日至2020年12月22日止向社会公开发行募集，本基金基金合同于2020年12月23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270,050,097.45份。自2020年12月23日至2022年8月18日期间，本基金按基金合同约定正常运作。根据《基金合同》等有关规定，本基金管理人经与基金托管人协商一致，并经本基金基金份额持有人大会投票表决，本次会议议案于2022年8月17日有效

通过，大会决议自通过之日起生效，本基金自 2022 年 8 月 19 日起进入清算程序。

3

四、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：国金惠宁中短期利率债债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 8 月 18 日

单位：人民币元

最后运作日

2022 年 8 月 18 日

资产：

银行存款 29,648.84

结算备付金 2,566.22

存出保证金 201.27

交易性金融资产 153,547.60

资产总计 185,963.93

负债：

应付管理人报酬 25.36

应付托管费 5.10

应付销售服务费 4.09

负债合计 34.55

所有者权益：

实收基金 179,672.24

未分配利润 6,257.14

所有者权益合计 185,929.38

负债和所有者权益总计 185,963.93

注：1、本基金最后运作日 2022 年 8 月 18 日，国金惠宁中短期利率债 A 基金份额为 112,716.94 份，国金惠宁中短期利率债 C 基金份额为 66,955.30 份；国金惠宁中短期利率债 A 基金资产净值为 116,732.16 元，国金惠宁中短期利率债 C 基金资产净值为 69,197.22 元；国金惠宁中短期利率债 A 单位净值为 1.0356 元，国金惠宁中短期利率债 C 单位净值为 1.0335 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

4

自 2022 年 8 月 19 日起至 2022 年 9 月 20 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财产中支付。

（二）资产处置情况

1、本基金最后运作日银行存款为人民币 29,648.84 元，其中包含应计利息人民币 21.81 元。清算期间，计提银行存款利息人民币 49.17 元。截至 2022 年 9 月 20 日，银行存款余额为人民币 181,924.12 元，其中包含应计银行存款利息余额为人民币 70.98 元。银行存款应计利息由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至托管账户，垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有；

2、本基金最后运作日结算备付金为人民币 2,566.22 元，其中结算备付金为人民币 2,563.53 元，应计利息为人民币 2.69 元。结算备付金人民币 2,550.49 元已于 2022 年 9 月 2 日划至托管账户，清算期间计提结算备付金利息人民币 1.68 元。截至 2022 年 9 月 20 日，结算备付金余额为人民币 17.41 元，其中结算备付金为人民币 13.04 元，应计利息为人民币 4.37 元。该款项将由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至托管账户；

3、本基金最后运作日存出保证金为人民币 201.27 元，其中存出保证金为人民币 200.58 元，应计利息为人民币 0.69 元。存出保证金人民币 96.03 元已于 2022 年 9 月 2 日划至托管账户，清算期间计提存出保证金利息人民币 0.14 元。截至 2022 年 9 月 20 日，存出保证金余额为人民币 105.38 元，其中存出保证金为人民币 104.55 元，应计利息为人民币 0.83 元。该款项将由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至托管账户；

4、本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 153,547.60 元，全部为债券投资。明细如下：

金额单位：人民币元

交
易
平

债券

名称 债券代码 最后运作日
单价 数量 最后运作日成本总额
最后运作日
应计利息
最后运作日估值总额

5
台
上
交
所
03 国

债⁽³⁾ 010303 101.21 1,500 151,815.00 1,732.60 153,547.60

以上债券投资于清算期处置变现，处置净损失为人民币 93.00 元，处置期间未产生交易费用，清算期间计提的债券利息为人民币 83.84 元，变现产生的证券清算款为人民币 153,538.44 元。

(三) 负债清偿情况

(1) 基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 25.36 元，已于清算期内支付；

(2) 基金最后运作日应付托管费为人民币 5.10 元，已于清算期内支付；

(3) 基金最后运作日应付销售服务费为人民币 4.09 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 2022 年 8 月 19 日

至 2022 年 9 月 20 日

止清算期间

一、清算期间收益

利息收入（注 1） 134.83

处置交易性金融资产产生的净收益（注 2） -93.00

清算收益小计 41.83

二、清算期间费用

清算费用小计 -

三、清算期间净损益 41.83

注 1：利息收入系计提的清算期间的银行活期存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息及债券利息。

注 2：处置交易性金融资产产生的净损失系清算期间卖出债券成交金额扣除最后运作日债券市值和卖出债券时应计利息的净额。

注 3：本次清算相关的清算费用由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。

(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 2022 年 8 月 18 日基金净资产 185,929.38

加：清算期间净损益 41.83

6

减：基金净赎回金额 3,924.30

2022 年 9 月 20 日净资产 182,046.91

截至本次清算期结束日 2022 年 9 月 20 日，本基金剩余财产为人民币

182,046.91 元。自本次清算期结束日次日 2022 年 9 月 21 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、《国金惠宁中短期利率债债券型证券投资基金清算报表审计报告》
- 2、《上海市通力律师事务所关于〈国金惠宁中短期利率债债券型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。

国金惠宁中短期利率债债券型证券投资基金

基金财产清算小组

2022 年 9 月 20 日

7

8

《国金惠宁中短期利率债债券型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：浙商银行股份有限公司（盖章）