

民生加银鑫安纯债债券型证券投资基金 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：中国银行股份有限公司

报告出具日期：2023年11月8日

报告送出日期：2023年11月17日

一、重要提示

民生加银鑫安纯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【2016】723号文准予注册，《民生加银鑫安纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）于2016年9月9日正式生效。本基金基金管理人为民生加银基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

依据《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”之“二、《基金合同》的终止事由”约定：“有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的；……”。

经本基金的基金管理人民生加银基金管理有限公司与本基金的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，本基金以通讯开会方式召开基金份额持有人大会，并于2023年10月18日计票并表决通过了《关于民生加银鑫安纯债债券型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》，基金管理人于2023年10月19日在规定媒介就本基金召开基金份额持有人大会审议通过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《民生加银鑫安纯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2023年10月20日起进入清算程序。本基金清算期为2023年10月20日至2023年11月8日，由本基金管理人民生加银基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、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	民生加银鑫安纯债债券型证券投资基金
基金简称	民生加银鑫安纯债债券
基金主代码	002684
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月9日
2023年10月19日日终基金份额总额	716,244.67份
投资目标	本基金在综合考虑基金资产收益性、安全性、流动性和严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求绝对收益，力争实现超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金奉行“自上而下”和“自下而上”相结合的主

	动式投资管理理念，采用价值分析方法，在分析和判断财政、货币、利率、通货膨胀等宏观经济运行指标的基础上，自上而下确定和动态调整大类资产比例和债券的组合目标久期、期限结构配置及类属配置；同时，采用“自下而上”的投资理念，在研究分析信用风险、流动性风险、供求关系、收益率水平、税收水平等因素基础上，自下而上的精选个券，把握固定收益类金融工具投资机会。	
业绩比较基准	中国债券综合指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	民生加银基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属基金份额类别的基金简称	民生加银鑫安纯债债券 A	民生加银鑫安纯债债券 C
下属基金份额类别的交易代码	002684	003173
2023 年 10 月 19 日日终下属基金份额类别的份额总额	216,307.55 份	499,937.12 份

三、基金运作情况概述

民生加银鑫安纯债债券型证券投资基金，系经中国证监会证监许可[2016]723 号文“关于准予民生加银鑫安纯债债券型证券投资基金注册的批复”准予注册，由民生加银基金管理有限公司自 2016 年 8 月 30 日至 2016 年 9 月 6 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2016)验字第 60950520_H11 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2016 年 9 月 9 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的有效认购资金(本金)为人民币 200,033,969.14 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 7.20 元，以上募集资金及利息合计为人民币 200,033,976.34 元，折合 200,033,976.34 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，注册登记机构为民生加银基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《基金合同》以及民生加银基金管理有限公司于 2023 年 10 月 19 日发布的《民生加银鑫安纯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》，本基金于 2023 年 10 月 20 日进入基金财产清算期，本基金的基金管理人已根据相关法律法规和本基金基金合同的规定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。

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：民生加银鑫安纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 10 月 19 日

单位：人民币元

	最后运作日 2023 年 10 月 19 日
资产：	
银行存款	886,666.04
结算备付金	4,042.23
存出保证金	182.53
资产总计	890,890.80
负债：	
应付管理人报酬	136.20
应付托管费	45.38
应付销售服务费	122.81
其他负债	44,400.00
负债合计	44,704.39
净资产：	
实收基金	716,244.67
未分配利润	129,941.74
净资产合计	846,186.41
负债和净资产总计	890,890.80

注 1：截至最后运作日 2023 年 10 月 19 日，民生加银鑫安纯债债券 A 基金份额为 216,307.55 份，基金份额净值为人民币 1.185 元，基金资产净值为人民币 256,379.03 元；民生加银鑫安纯债债券 C 基金份额为 499,937.12 份，基金份额净值为人民币 1.180 元，基金资产净值为人民币 589,807.38 元。

注 2：本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《资产管理产品相关会计处理规定》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。基金管理人编制清算报表是为了呈报本基金全体基金份额持有人以及中国证监会使用。因此，清算报表不适用于其他用途。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

清算期间自2023年10月20日至2023年11月8日止，本基金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。基金资产处置、负债清偿及清算期间的清算损益情况如下：

1、资产处置情况

(1) 本基金于 2023 年 10 月 19 日(最后运作日)银行存款及其应计利息总和为人民币 886,666.04 元，

其中托管户存款为人民币 886,532.78 元，应计银行存款利息为人民币 133.26 元。应计利息款项将于下一季度结息日后划入本基金托管账户。

- (2) 本基金于 2023 年 10 月 19 日(最后运作日)结算备付金及其应计利息总和为人民币 4,042.23 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金本金为人民币 4,041.51 元，应计利息为人民币 0.72 元。上述结算备付金本金已于 2023 年 11 月 8 日划付至本基金托管账户，应计利息款项将于下一季度结息日后划入本基金托管账户。
- (3) 本基金于 2023 年 10 月 19 日(最后运作日)存出保证金及其应计利息总和为人民币 182.53 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金本金为人民币 176.41 元，应计利息为人民币 0.29 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金本金为人民币 5.83 元，无应计利息。上述存出保证金本金已于 2023 年 11 月 2 日划入本基金托管账户，应计利息款项将于下一季度结息日后划入本基金托管账户。

2、负债清偿情况

- (1) 本基金于 2023 年 10 月 19 日(最后运作日)应付管理人报酬为人民币 136.20 元，该款项已于 2023 年 10 月 20 日支付。
- (2) 本基金于 2023 年 10 月 19 日(最后运作日)应付托管费为人民币 45.38 元，该款项已于 2023 年 10 月 20 日支付。
- (3) 本基金于 2023 年 10 月 19 日(最后运作日)应付销售服务费为人民币 122.81 元，该款项已于 2023 年 10 月 20 日支付。
- (4) 本基金于 2023 年 10 月 19 日(最后运作日)其他负债为人民币 44,400.00 元。其中包括预提律师费人民币 25,000.00 元、预提公证费人民币 10,000.00 元、预提审计费人民币 9,300.00 元和预提汇划费人民币 100.00 元，除公证费人民币 10,000.00 元及汇划费人民币 30.00 元以外，其余款项尚未支付。

3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2023年10月20日起至 2023年11月8日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	141.35
清算收益小计	141.35
二、清算支出	

清算支出小计	-
三、清算净收益	141.35

注1：利息收入系计提的自2023年10月20日起至2023年11月8日止清算期间的银行存款利息收入、结算备付金利息收入和存出保证金利息收入。其中，银行存款利息收入为人民币137.80元；结算备付金利息收入为人民币3.42元；存出保证金利息收入为人民币0.13元。

注2：清算期间自2023年10月20日起至2023年11月8日止。

4、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
一、最后运作日2023年10月19日基金净资产	846,186.41
加：清算期间净收益	141.35
减：基金净赎回金额（于2023年10月20日确认的投资者赎回申请）	210,176.16
二、清算结束日2023年11月8日基金净资产	636,151.60

资产处置及负债清偿后，2023年11月8日本基金剩余财产为人民币636,151.60元。根据《基金合同》以及民生加银基金管理有限公司于2023年10月19日发布的《民生加银鑫安纯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》，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。自清算结束日次日至清算款划出日前一日的归属于基金份额持有人的银行存款孳生的利息归基金份额持有人所有。

六、 备查文件

1、备查文件目录

- (1) 民生加银鑫安纯债债券型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- (2) 关于《民生加银鑫安纯债债券型证券投资基金清算报告》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

民生加银鑫安纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

2023年11月8日