

兴银合富债券型证券投资基金清算报告

基金管理人：兴银基金管理有限责任公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

清算报告出具日：2021年4月8日

清算报告公告日：2021年4月17日

一、重要提示

兴银合富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 2020 年 6 月 18 日《关于准予兴银尊享债券型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可【2020】1255 号）变更注册后公开募集，自 2020 年 8 月 13 日起《兴银合富债券型证券投资基金基金合同》生效，基金管理人为兴银基金管理有限责任公司，基金托管人为江苏银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》第四十七条的规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：（二）决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同”；第八十条规定，“有下列情形之一的，基金合同终止：（二）基金份额持有人大会决定终止”。根据《兴银合富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”）第十九部分约定，“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”。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条的规定，“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。

本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议了《关于终止兴银合富债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，议案于 2021 年 2 月 22 日表决通过，并自该日起本次基金份额持有人大会决定的事项生效，详见基金管理人于 2021 年 2 月 23 日刊登在《证券日报》和基金管理人官网（www.hffunds.cn）的《关于兴银合富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》。

本基金最后运作日为 2021 年 2 月 22 日，自 2021 年 2 月 23 日起进入清算程序，清算期间为自 2021 年 2 月 23 日至 2021 年 3 月 23 日止。基金管理人、基金托管人、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2021 年 2 月 26 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

二、基金概况

基金名称	兴银合富债券型证券投资基金
基金简称	兴银合富债券
基金主代码	009915
交易代码	009915
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 13 日

最后运作日（2021-2-22）基金份额总额	1,018,353.60 份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用期限匹配下的主动性投资策略，主要包括：类属资产配置策略、期限结构配置策略、久期配置策略、收益率曲线、杠杆策略等投资管理手段，对债券市场及债券收益率曲线的变化进行预测，相机而动、积极调整。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司
基金托管人	江苏银行股份有限公司

三、基金运作情况

本基金经中国证监会 2020 年 6 月 18 日证监许可【2020】1255 号文变更注册，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于 2020 年 7 月 28 日至 2020 年 8 月 10 日向社会公开募集。本基金基金合同于 2020 年 8 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 201,033,907.19 份（含募集期间利息结转的份额）。自 2020 年 8 月 13 日至 2021 年 2 月 22 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

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》、《兴银合富债券型证券投资基金基金合同》等有关规定，经本基金份额持有人大会 2021 年 2 月 22 日表决通过，决定终止基金合同，并对本基金进行变现及清算程序。详见基金管理人于 2021 年 2 月 23 日刊登在《证券日报》和基金管理人官网（www.hffunds.cn）的《关于兴银合富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》，本基金从 2021 年 2 月 23 日起进入清算期。

四、财务会计报告

1、清算期间

兴银合富债券型证券投资基金的清算期间为 2020 年 2 月 23 日至 2020 年 3 月 23 日止。

2、清算财务报表的编制基础

本清算报表仅为供本基金基金管理人用以本基金清算相关监管报送或公告之目的而编制，本清算报表以非持续经营为基础编制。因此，本清算报表列示资产和负债时不再区分流动资产和非流动资产、流动负债和非流动负债，期末资产项目以预计可收回金额列报，负债项目按照需要偿付的金额列报，实收基金和未分配利润以所有者权益项目进行列报。本清算报表仅列示了2021年2月22日(最后运作日)及2021年3月23日(清算结束日)的清算资产负债表和2021年2月23日(清算开始日)至2021年3月23日(清算结束日)止清算期间的清算损益表及重要报表项目说明，除上述内容外，本基金遵循《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《关于兴银合富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》及基金合同的有关规定。

清算资产负债表（经审计）

单位：人民币元

项目	2021年2月22日 (最后运作日)	2021年3月23日 (清算结束日)
资产：		
银行存款	138,533.84	1,054,696.69
结算备付金	3,575.95	-
存出保证金	299.08	444.98
债券投资	905,540.00	-
应收利息	14,975.62	63.33
其他应收款	69,999.92	69,999.92
资产总计	1,132,924.41	1,125,204.92
负债：		
应付管理人报酬	187.94	-
应付托管费	31.28	-
预提费用	138,976.30	169,999.81
负债合计	139,195.52	169,999.81
所有者权益：		
实收基金	1,018,353.60	1,018,353.60
未分配利润	-24,624.71	-63,148.49
所有者权益合计	993,728.89	955,205.11
负债和所有者权益总计	1,132,924.41	1,125,204.92

注：1、本基金最后运作日2021年2月22日，基金份额净值0.9758元，基金总份额1,018,353.60份，基金资产净值993,728.89元。

清算损益表（经审计）

单位：人民币元

项目	2021年2月23日（清算开始日） 至 2021年3月23日（清算结束日）
一、收益	212.31
1、利息收入	682.31
2、差价收入	-3,342.47
3、公允价值变动损益	2,872.47
4、其他收入	-
二、费用	38,736.09
1、管理人报酬	-
2、基金托管费	-
3、交易费用	12.58
4、利息支出	-
5、税金及附加	-
5、其他费用	38,723.51
三、收益（损失）总额	-38,523.78
减：所得税费用	-
四、净收益（损失）	-38,523.78

注：1、利息收入是以当前适用的利率计提的自2021年2月23日至2021年3月23日止清算期间的利息收入，其中银行存款利息人民币593.76元；备付金利息人民币1.15元和保证金利息人民币0.57元；清算期间持有的债券投资产生的债券利息收入人民币86.83元；

2、差价收入是清算期间债券投资变现的差价收入；

3、公允价值变动损益是清算期间处置持有的债券投资导致转出计入投资收益的公允价值变动；

4、交易费用是清算期间债券投资变现产生的交易费用；

5、其他费用包括清算审计费36,500元，银行间账户维护费和查询费2,223.51元。

五、清算情况

自2021年2月23日至2021年3月23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：

1、根据《关于兴银合富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 2021 年 2 月 23 日起(含 2021 年 2 月 23 日)，停止收取基金管理费、基金托管费。

2、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，按照《基金合同》的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

3、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款 138,533.84 元，存储于基金托管人江苏银行股份有限公司；

(2) 本基金最后运作日结算备付金 3,575.95 元，已于 2021 年 3 月 2 日全部到账；

(3) 本基金最后运作日存出保证金 299.08 元，于 2021 年 3 月 2 日经交易所调整为 444.98 元。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付存出保证金；

(4) 本基金最后运作日债券投资 905,540.00 元，已于 2021 年 2 月 23 日全部卖出，卖出清算款已于 2021 年 2 月 24 日到账；

(5) 本基金最后运作日应收利息为人民币 14,975.62 元，包含应收债券利息人民币 14,805.04 元、应收活期银行存款利息人民币 166.58 元、应收备付金利息人民币 3.36 元和应收保证金利息人民币 0.64 元。其中应收债券利息已于 2 月 24 日随债券卖出清算款到账；应收银行活期存款利息由托管银行于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日(节假日顺延)结算入账，或在账户注销时一次性结清；应收备付金和应收保证金利息由中国证券登记结算有限责任公司于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日(节假日顺延)结算入账。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付尚未收讫的利息（该金额可能与实际结息金额存在略微差异）。

(6) 本基金最后运作日其他应收款 69,999.92 元，为基金管理人代为承担的本基金部分信息披露费。

4、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬 187.94 元，该款项已于 2021 年 3 月 3 日支付；

(2) 本基金最后运作日应付托管费 31.28 元，该款项已于 2021 年 3 月 3 日支付；

(3) 本基金最后运作日预提费用 138,976.30 元，其中银行间帐户维护费及查询费 5,476.49 元，已于 2021 年 3 月 3 日支付；2020 年产品年度审计费 13,499.81 元，待收到发票后进行支付；信息披露费 120,000.00 元，待收到发票后进行支付。

5、剩余财产分配

资产处置及负债清偿后，于 2021 年 3 月 23 日本基金剩余财产为人民币 955,205.11 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。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付交易所存出保证金、存款利息（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

6、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) 《兴银合富债券型证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《关于<兴银合富债券型证券投资基金清算报告>的法律意见》

2、存放地点

基金管理人处。

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。

兴银合富债券型证券投资基金基金财产清算小组
2021 年 4 月 17 日