

# 国融稳融债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：国融基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

报告出具日期：二〇二〇年七月三日

报告公告日期：二〇二〇年七月十七日

## 1、重要提示

### 1.1 重要提示

国融稳融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〔2018〕1293号《关于准予国融稳融债券型证券投资基金注册的批复》准予注册,注册日期为2018年8月13日。本基金于2019年1月30日成立并正式运作。

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》、《国融稳融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”)等有关规定,《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60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并等,并召开基金份额持有人大会进行表决,但基金合同另有约定的除外;在连续60个工作日出现上述情形时,若基金管理人与基金托管人协商一致,对本基金进行清算,终止本基金合同,则无需召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

截至2020年6月12日,本基金基金资产净值已超过连续60个工作日低于5000万元。根据基金合同有关约定,且经与基金托管人协商一致,基金管理人决定终止本基金基金合同,并对本基金基金财产进行清算,不需召开基金份额持有人大会。

2020年6月12日为本基金运作的最后一日,由本基金管理人国融基金管理有限公司、基金托管人华泰证券股份有限公司、毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所指定人员组成的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)对本基金清算报告进行审计,上海源泰律师事务所对本基金清算报告出具法律意见。

## 2、基金概况

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国融稳融债券型证券投资基金
------	---------------

基金简称	国融稳融债券	
基金编码	006356	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年01月30日	
基金管理人	国融基金管理有限公司	
基金托管人	华泰证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,958.72份	
基金最后运作日	2020年6月12日	
基金各份额类别简称	国融稳融债券A	国融稳融债券C
基金各份额类别代码	006356	006357
报告期末各份额类别的份额总额	10,110.32份	1,848.40份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，自上而下决定资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数*80%+沪深300指数收益率*15%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）*5%。
风险收益特征	本基金是债券型基金，长期预期风险与收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

## 3、基金最后运作日财务会计报告（经审计）

### 3.1 资产负债表

会计主体：国融稳融债券型证券投资基金

报告截止日：2020年6月12日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	2020年6月12日 (基金最后运作日)
资产：	
银行存款	118,045.93

结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	10,019.50
其中：股票投资	-
债券投资	10,019.50
资产支持证券投资	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	1,937.57
应收申购款	-
<b>资产总计</b>	<b>130,003.00</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>2020年6月12日 (基金最后运作日)</b>
<b>负债：</b>	
应付证券清算款	-
卖出回购金融资产款	-
应付赎回款	105,316.76
应付基金管理费	23.30
应付基金托管费	3.86
应付销售服务费	7.08
应付交易费用	-
应付税费	-
应付利息	-
其他负债	12,552.93
<b>负债合计</b>	<b>117,903.93</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	11,958.72
未分配利润	140.35
<b>所有者权益合计</b>	<b>12,099.07</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>130,003.00</b>

注：报告截止日 2020 年 6 月 12 日（基金最后运作日），基金份额总额 11,958.72 份，基金资产净值总额 12,099.07 元。其中 A 类基金份额净值 1.0125 元，基金份额总额 10,110.32 份，基金份额资产净值 10,236.56 元；C 类基金份额净值 1.0076 元，基金份额总额 1,848.40 份，基金份额资产净值 1,862.51 元。

### 3.2 利润表

会计主体：国融稳融债券型证券投资基金

会计期间：2020年6月13日至2020年7月3日（清算结束日）

单位：人民币元

项目	2020年6月13日(清算开始日)至2020年7月3日(清算结束日)止期间
<b>一、清算收益</b>	<b>36.31</b>
1.利息收入	34.31
2.公允价值变动损益	23.00
3.投资收益	-21.00
4.其他收入	-
<b>二、清算费用</b>	<b>892.15</b>
1.交易费用	2.00
2.其他费用	890.15
<b>三、清算收益（损失）总额</b>	<b>-855.84</b>
减：所得税费用	-
减：税金及附加	-
<b>四、清算净收益（损失）</b>	<b>-855.84</b>

## 4、清盘事项说明

### 4.1 基金基本情况

国融稳融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”）《关于准予国融稳融债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]1293号）批准，由国融基金管理有限公司（以下简称“国融基金公司”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规以及《国融稳融债券型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2019年1月30日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为230,669,552.13份基金份额。本基金的基金管理人为国融基金公司，基金托管人为华泰证券股份有限公司（以下简称“华泰证券”）。

根据经中国证监会备案的《国融稳融债券型证券投资基金基金合同》和《国融稳融债券型证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购 / 申购费用、销售服务

费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购 / 申购基金份额时收取认购 / 申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；从本类基金份额基金资产中计提销售服务费，并不收取认购 / 申购费用的基金份额，称为C类基金份额。相关费率的设置及费率水平在本基金招募说明书或相关公告中列示。本基金各类基金份额分别设置代码，分别计算和公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资者在认购 / 申购基金份额时可自行选择认购 / 申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国融稳融债券型证券投资基金基金合同》和《国融稳融债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票），债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、国债期货、权证、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款等，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本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；股票资产的投资比例不超过基金资产的20%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数×80% + 沪深300指数收益率×15% + 金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。

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》、《国融稳融债券型证券投资基金基金合同》等有关规定及国融基金公司发布的《关于国融稳融债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，国融稳融债券基金自2020年6月13日起进入清算程序。国融基金公司和华泰证券按照《国融稳融债券型证券投资基金基金合同》的规定对国融稳融债券基金进行终止清算，清算工作于2020年7月3日完成。国融稳融债券基金的清算期间为自2020年6月13日（“清算起始日”）开始至2020年7月3日（“清算结束日”）止期间。

## 4.2 清算原因

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》、《国融稳融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”）等有关规定，《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60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并等，并召开基金份额持有人大会进行表决，但基金合同另有约定的除外；在连续60个工作日出现上述情形时，若基金管理人与基金托管人协商一致，对本基金进行清算，终止本基金合同，则无需召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

截至2020年6月12日，本基金基金资产净值已超过连续60个工作日低于5000万元。根据基金合同有关约定，且经与基金托管人协商一致，基金管理人决定终止本基金基金合同，并对本基金基金财产进行清算，不需召开基金份额持有人大会。

## 4.3 清算起始日

根据《国融稳融债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金的清算起始日为2020年6月13日。

## 4.4 清算财务报表的编制基础

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。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。

# 5、清算情况

自2020年6月13日至2020年7月3日止为本次清算期间，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、负债清偿及基金净资产具体清算情况如下：

## 5.1 清算费用

根据基金合同中“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用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。本次清算期间共发生清算费用40,000.00元，

其中：律师费用 20,000.00 元，审计费用 20,000.00 元。截止 2020 年 6 月 12 日已在基金财产预先计提的审计费用为 13,443.08 元，考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的剩余清算审计费 6,556.92 元，律师费用 20,000.00 元，由基金管理人代为支付。

## 5.2 资产处置情况

1.本基金于最后运作日的银行存款余额为人民币 118,045.93 元，清算期间收到处置金融资产的款项人民币 10,021.50 元，收回利息人民币 1,958.38 元，支付赎回款项人民币 105,316.76 元，支付专业服务费人民币 13,443.08 元，支付管理人报酬人民币 23.30 元，支付销售服务费人民币 7.08 元，支付托管费人民币 3.86 元，支付佣金及其他交易费用人民币 2.00 元。于清算结束日的银行存款余额为人民币 11,229.73 元。

2.本基金于最后运作日的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产余额为人民币 10,019.50 元，均为债券投资。于清算结束日的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产余额为零。

3.本基金于最后运作日的应收利息余额为人民币 1,937.57 元，清算期间利息收入为人民币 34.31 元，收回利息为人民币 1,958.38 元，于清算结束日的应收利息余额为人民币 13.50 元。

## 5.3 负债清偿情况

1.本基金最后运作日应付赎回款 105,316.76 元，该款项已于 2020 年 6 月 16 日支付。

2.本基金最后运作日应付基金管理费为人民币 23.30 元，该款项已于 2020 年 7 月 3 日支付。

3.本基金最后运作日应付基金托管费为人民币 3.86 元，该款项已于 2020 年 7 月 3 日支付。

4.本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 7.08 元，该款项已于 2020 年 7 月 3 日支付。

5.本基金最后运作日其他负债为人民币 12,552.93 元，包括应付审计费 13,443.08 元，应付中债账户维护费-890.15 元，应付审计费已于 2020 年 7 月 3 日支付；中债账户维护费因销户已于 2020 年 6 月 5 日提前支付。

## 5.4 资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

项目	金额/份额
一、最后运作日 2020 年 6 月 12 日基金净资产（单位：元）	12,099.07



加：清算期间净收益	-855.84
<b>二、2020年7月3日基金净资产</b>	<b>11,243.23</b>
其中：归属于A类基金份额的基金净资产	9,512.43
其中：归属于C类基金份额的基金净资产	1,730.80
<b>三、2020年7月3日基金总份额（单位：份）</b>	<b>11,958.72</b>
其中：A类基金份额数量	10,110.32
其中：C类基金份额数量	1,848.40

截至本次清算期结束日2020年7月3日，本基金剩余财产为人民币11,243.23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可供分配财产为人民币11,243.23元，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。自本次清算期结束日次日2020年7月4日至本次清算款划出前一日的银行存款产生的利息亦归全体基金份额持有人所有。

为充分保护基金份额持有人利益，便于及时向基金份额持有人分配剩余全部资产，基金管理人国融基金管理有限公司将以自有资金划入托管账户，用以垫付截至清算款划款日未变现的应收利息（不含清算款划款日当日的应收利息）。基金管理人所垫付的资金以及本次清算款划出日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人，基金财产清偿完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。本基金的银行存款应收利息为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，资产支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中基金管理人垫付资金与实际返还金额的差额由基金管理人承担。

### 5.5 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，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案通过后在指定媒介向基金投资者公告。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分配。

## 6、备查文件目录

### 6.1 备查文件目录

6.1.1 国融稳融债券型证券投资基金清算财务报表及审计报告

6.1.2 《国融稳融债券型证券投资基金清算报告》的法律意见书

## 6.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所

## 6.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人国融基金管理有限公司。

客服电话：4008-190-098。

国融稳融债券型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二〇年七月三日