

国金基金管理有限公司  
国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证  
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：中国民生银行股份有限公司

清算报告出具日期：2022 年 4 月 29 日

清算报告公告日期：2022 年 5 月 13 日

## 一、重要提示

国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券投资基金（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【2017】1263 号文准予注册募集，于 2017 年 11 月 24 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”），基金托管人为中国民生银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”或“民生银行”）。

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《国金民丰回报 6 个月定期开放混合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 3 月 3 日发布《关于以通讯方式召开国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，审议《关于终止国金民丰回报 6 个月定期开放混合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 3 月 4 日起，至 2022 年 4 月 5 日 15:00 止。本次会议议案于 2022 年 4 月 6 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 4 月 7 日发布《关于国金民丰回报 6 个月定期开放混合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 4 月 8 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 4 月 8 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。

## 二、基金概况

基金名称	国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券投资基金
基金简称	国金民丰回报
基金代码	005018
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2017 年 11 月 24 日
基金最后运作日（2022 年 4 月 7 日）基金份额总额	5,254,814.02 份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
主要投资策略	<ol style="list-style-type: none"><li>1、资产配置策略</li><li>2、债券投资策略</li><li>3、可转换债券投资策略</li><li>4、资产支持证券投资策略</li><li>5、量化选股模型</li><li>6、股指期货投资策略</li><li>7、国债期货投资策略</li><li>8、权证投资策略</li><li>9、开放期投资策略</li></ol>
业绩比较基准	$80\% \times \text{中证全债指数收益率} + 15\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率（税后）}$
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

### 三、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2017】1263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2017年10月18日至2017年11月17日止向社会公开发行人募集，本基金基金合同于2017年11月24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265,428,206.57份。自2017年11月24日至2022年4月7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4月6日有效通过，大会决议自通过之日起生效，本基金自2022年4月8日起进入清算程序。

## 四、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 4 月 7 日

单位：人民币元

	最后运作日 2022 年 4 月 7 日
<b>资产：</b>	
银行存款	5,342,574.40
结算备付金	350,707.36
存出保证金	5,073.53
交易性金融资产	1,000.18
应收证券清算款	525,443.27
资产总计	6,224,798.74
<b>负债：</b>	
应付管理人报酬	1,618.46
应付托管费	202.30
应付交易费用	2,792.24
应付税费	3.84
其他负债	50,000.00
负债合计	54,616.84
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	5,254,814.02
未分配利润	915,367.88
所有者权益合计	6,170,181.90
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>6,224,798.74</b>

注：1、本基金最后运作日 2022 年 4 月 7 日，基金份额总额为 5,254,814.02 份，基金资产净值为 6,170,181.90 元，本基金单位净值为 1.1742 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

自 2022 年 4 月 8 日起至 2022 年 4 月 29 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 5,342,574.40 元，其中包含应计利息人民币 424.54 元。清算期间，计提银行存款利息人民币 1,246.71 元。截至 2022 年 4 月 29 日，银行存款余额为人民币 5,800,717.50 元，其中包含应计银行存款利息余额为人民币 1,671.25 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 350,707.36 元，其中上海结算备付金为人民币 347,965.03 元，应计利息为人民币 147.00 元；深圳结算备付金为人民币 2,593.01 元，应计利息为人民币 2.32 元。清算期间，计提上海结算备付金利息人民币 344.52 元，计提深圳结算备付金利息人民币 2.64 元。截至 2022 年 4 月 29 日，结算备付金余额为人民币 351,054.52 元，其中上海结算备付金为人民币 347,965.03 元，应计利息为人民币 491.52 元；深圳结算备付金为人民币 2,593.01 元，应计利息为人民币 4.96 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 5,073.53 元，其中上海存出保证金为人民币 3,045.48 元，应计利息为人民币 3.32 元；深圳存出保证金为人民币 2,022.79 元，应计利息为人民币 1.94 元。清算期间，计提上海存出保证金利息人民币 3.08 元，计提深圳存出保证金利息人民币 1.98 元。截至 2022 年 4 月 29 日，存出保证金余额为人民币 5,078.59 元，其中上海存出保证金为人民币 3,045.48 元，应计利息为人民币 6.40 元；深圳存出保证金为人民币 2,022.79 元，应计利息为人民币 3.92 元。存出保证金应计利息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 1,000.18 元，全部为债券投资，其中包含应计债券利息人民币 0.18 元。明细如下：

金额单位：人民币元

交易平台	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
深交所	中特转债	127056	100.00	10	1,000.00	0.18	1,000.18

以上债券投资于清算期处置变现，变现产生的证券清算款为人民币 1,069.96 元，清算期间计提的债券利息为人民币 0.04 元，已于清算期间划入托管户。交易费用为人民币 0.04 元，已于清算期内支付；

5、本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 525,443.27 元，已于 2022 年 4 月 8 日划入托管户，清算期间发生应收证券清算款人民币 1,069.96 元，已于 2022 年 4 月 18 日划至托管户。

### （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 1,618.46 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 202.30 元，已于清算期内支付；

（3）基金最后运作日应付交易费用为人民币 2,792.24 元，已于清算期内支付；

（4）基金最后运作日应付税费为人民币 3.84 元，已于清算期内支付；

（5）基金最后运作日其他负债为人民币 50,000.00 元，为本基金 2021 年年度审计费用，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 4 月 8 日至 2022 年 4 月 29 日止清算期间
一、清算期间收益	
利息收入（注 1）	1,598.97
处置交易性金融资产产生的净收益（注 2）	69.78
清算收益小计	1,668.75
二、清算期间费用	

清算审计费	15,000.00
债券交易费用（注3）	0.04
清算费用小计	15,000.04
三、清算期间净损益	-13,331.29

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收益系清算期间卖出债券成交金额扣除最后运作日债券市值的净额。

注3：债券交易费用在清算期间共发生人民币0.04元，已于清算期内支付。

注4：除上述清算费用外的其他与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4月7日基金净资产	6,170,181.90
加：清算期间净损益	-13,331.29
减：基金净赎回金额	-
2022年4月29日净资产	6,156,850.61

截至本次清算期结束日2022年4月29日，本基金剩余财产为人民币6,156,850.61元。自本次清算期结束日次日2022年4月30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、《国金民丰回报 6 个月定期开放混合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<国金民丰回报 6 个月定期开放混合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。

国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券投资基金

基金财产清算小组

2022 年 4 月 29 日

《国金民丰回报 6 个月定期开放混合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：中国民生银行股份有限公司（盖章）