

# 兴业中短债债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：兴业基金管理有限公司  
基金托管人：中国民生银行股份有限公司  
清算报告公告日：2022年1月11日

## 一、重要提示

兴业中短债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由兴业 14 天理财债券型证券投资基金（以下简称“兴业 14 天理财”）转型而成。兴业 14 天理财系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《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》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）以证监许可[2016]1945 号文准予募集注册。募集结束后，该产品于 2016 年 10 月 24 日获中国证监会机构部函[2016]2577 号文备案后正式成立，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”）。

本基金由中国证券监督管理委员会 2020 年 9 月 10 日证监许可[2020]2183 号文准予变更注册。并以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议通过了《关于兴业 14 天理财债券型证券投资基金转型有关事项的议案》，自 2020 年 12 月 15 日起，兴业 14 天理财正式转型为兴业中短债债券型证券投资基金。

根据相关法律法规和《兴业中短债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，基金份额持有人大会决定终止《基金合同》的，《基金合同》应当终止。本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，于 2021 年 12 月 16 日计票并表决通过了《关于终止兴业中短债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本基金管理人于 2021 年 12 月 17 日发布了《兴业基金管理有限公司关于兴业中短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》。本基金最后运作日为 2021 年 12 月 17 日，自 2021 年 12 月 20 日起，本基金进入清算程序。

本基金基金财产清算小组于 2021 年 12 月 20 日成立。本基金基金财产清算小组由基金管理人兴业基金管理有限公司、基金托管人中国民生银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)、上海市通力律师事务所组成，由德勤华永会计师事务所（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

### 1、基金基本情况

基金名称:	兴业中短债债券型证券投资基金	
基金简称:	兴业中短债债券	
基金主代码:	003430	
基金运作方式:	契约型开放式	
基金合同生效日:	2020 年 12 月 15 日	
基金管理人名称:	兴业基金管理有限公司	
基金托管人名称:	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴业中短债债券 A	兴业中短债债券 C
下属分级基金的交易代码	003431	003430

### 2、基金产品说明

投资目标	本基金主要投资中短期债券，在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，
------	-----------------------------------

	力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，融合规范化的基本面研究和严谨的信用分析，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定类属资产配置和债券组合久期、期限结构；在严谨深入的信用分析基础上，综合考量信用债券的信用评级，以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上精选投资标的。本基金采用的主要策略包括：1、久期配置策略；2、期限结构配置策略；3、类属配置策略；4、个券精选策略；5、息差策略；6、信用债投资策略；7、证券公司短期公司债券投资策略；8、资产支持证券投资策略；9、信用衍生品投资策略。
业绩比较基准	中债总财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 三、财务会计报告

#### 资产负债表（经审计）

会计主体：兴业中短债债券型证券投资基金

单位：人民币元

	最后运作日 2021年12月17日	清算结束日 2021年12月27日
<b>资产：</b>		
银行存款	284,278.29	2,273,422.81
交易性金融资产	2,000,000.00	
应收利息	44,148.05	320.15
<b>资产总计</b>	<b>2,328,426.34</b>	<b>2,273,742.96</b>
<b>负债：</b>		
应付赎回款	99.93	
应付管理人报酬	323.80	
应付托管费	53.98	
应付销售服务费	418.69	
应付交易费用	767.50	22.50
其他负债	53,431.76	60.00
<b>负债合计</b>	<b>55,095.66</b>	<b>82.50</b>
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	2,238,584.41	2,238,483.13
未分配利润	34,746.27	35,177.33

所有者权益合计	2, 273, 330. 68	2, 273, 660. 46
负债和所有者权益总计	2, 328, 426. 34	2, 273, 742. 96

注：

1、本基金最后运作日 2021 年 12 月 17 日，基金份额净值人民币 1.0155 元，基金份额总额 2,238,584.41 份。其中下属 A 类基金份额净值 1.0188 元，基金份额总额 10,751.72 份，下属 C 类基金份额净值 1.0155 元，基金份额总额 2,227,832.69 份。

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。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。德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已对财务报表进行了审计并出具了无保留意见的审计报告。

#### 四、清算情况

本基金的清算期间为 2021 年 12 月 20 日（清算开始日）起至 2021 年 12 月 27 日（清算结束日）止期间。

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、清算费用

按照《兴业中短债债券型证券投资基金基金合同》第十八部分“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。

##### 2、最后运作日资产处置情况

(1) 本基金最后运作日活期存款人民币 284,278.29 元，是存储于基金托管人中国民生银行股份有限公司的活期银行存款。

(2) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 2,000,000.00 元，全部为债券投资，已全部于清算期处置变现。

(3) 本基金最后运作日应收利息人民币 44,148.05 元，其中包括活期银行存款利息人民币 383.67 元，债券利息人民币 43,764.38 元。活期银行存款利息一般于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月的 21 日（节假日顺延）结息，该款项已于 2021 年 12 月 21 日结息。结息日后至清算款划出前产生的应收利息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。债券利息已随交易性金融资产处置变现。

##### 3、最后运作日负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 323.80 元，该款项已于清算期间支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 53.98 元，该款项已于清算期间支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 418.69 元，该款项已于清算期间支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 767.50 元，为银行间交易费用，其中银行间结算服务费 750.00 元已于清算期间支付，银行间交易手续费 17.50 元待收到缴费单后支付。

(5) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 99.93 元，该款项已于清算期间支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 53,431.76 元, 包括预提审计费、信息披露费、账户维护费。其中预提审计费为人民币 20,000.00 元; 预提信息披露费为 28,931.76 元; 账户维护费 4,500.00 元。该款项已于清算期间支付。

#### 4、最后运作日赎回申请及赎回款支付情况

本基金管理人于 2021 年 12 月 20 日确认的最后运作日赎回申请共计 101.28 份, 应付赎回款金额为人民币 102.85 元, 该款项已于清算期间支付。

#### 5、清算期间的损益情况

单位: 人民币元

项目	自 2021 年 12 月 20 日 (清算开始日) 至 2021 年 12 月 27 日 (清算结束日)
<b>一、清算收入</b>	<b>702.63</b>
利息收入 (注 1)	646.63
投资收益 (注 2)	-34.70
公允价值变动损益 (注 2)	90.70
<b>二、清算费用</b>	<b>270.00</b>
交易费用 (注 2)	155.00
其他费用 (注 3)	115.00
<b>三、清算净收益</b>	<b>432.63</b>

注:

- 1、利息收入系以当前适用利率预估计提的最后运作日至清算结束日期间的银行存款利息收入人民币 378.13 元和交易性金融资产利息收入人民币 268.50 元, 共计人民币 646.63 元。
- 2、投资收益、公允价值变动损益、交易费用系处置交易性金融资产期间产生的收入、费用。
- 3、其他费用系清算期间产生的汇划手续费人民币 115.00 元。

#### 6、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	自 2021 年 12 月 20 日 (清算开始日) 至 2021 年 12 月 27 日 (清算结束日)
一、最后运作日 2021 年 12 月 17 日基金净资产	2,273,330.68
加: 清算期间净收益	432.63
减: 最后运作日有效赎回申请对应赎回款	102.85
二、2021 年 12 月 27 日基金净资产	2,273,660.46

注:

资产处置及负债清偿后, 2021 年 12 月 27 日本基金剩余财产为人民币 2,273,660.46 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、缴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。

2021 年 12 月 28 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属基金份额持有人所有。

为保护基金份额持有人利益, 加快清盘速度, 若于基金剩余财产划出日尚未收到应收利息结

息，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（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。结息尾差由基金管理人承担。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。

## 7、基金财产清算报告的告知安排

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，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

## 六、备查文件目录

### 1、备查文件目录

- (1) 《兴业中短债债券型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 上海市通力律师事务所关于《兴业中短债债券型证券投资基金清算报告》的法律意见。

### 2、存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.cib-fund.com.cn](http://www.cib-fund.com.cn)）查阅。

### 3、查阅方式

本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

兴业中短债债券型证券投资基金  
基金财产清算小组  
2021年12月31日