

金鹰添鑫定期开放债券型发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二二年一月二十日

清算报告公告日：二〇二二年三月八日

§1 重要提示

金鹰添鑫定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2018 年 11 月 2 日《关于准予金鹰添鑫定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可【2018】1781 号）注册公开募集，自 2018 年 12 月 26 日起《金鹰添鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）生效，本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中信银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

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》等法律法规的规定和《基金合同》的有关规定，本基金基金合同生效之日起 3 年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。本基金的基金合同生效日为 2018 年 12 月 26 日，基金合同生效之日起 3 年后的对应日为 2021 年 12 月 26 日。截至 2021 年 12 月 26 日日终，本基金的基金资产净值低于 2 亿元，已触发上述《基金合同》约定的自动终止情形，基金管理人将根据相关法律法规、基金合同等规定对本基金进行清算。并于 2021 年 12 月 27 日在指定媒介就本基金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《金鹰添鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金最后运作日为 2021 年 12 月 26 日。本基金从 2021 年 12 月 27 日起进入清算期，清算期间为自 2021 年 12 月 27 日至 2022 年 01 月 19 日止。由基金管理人、基金托管人、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和广东岭南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，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，广东岭南律师事务所对清算事宜出具法律意见。

§2 基金概况

基金简称	金鹰添鑫定期开放债券
------	------------

基金主代码	006788
交易代码	006788
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月26日
最后运作日(2021-12-26) 基金份额总额	10,000,000.00份
最后运作日(2021-12-26) 基金净值	10,124,927.58
投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上,力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金主要投资于固定收益类金融工具,在充分考虑基金资产的安全性、收益性及流动性的前提下,通过分析经济周期变化、货币政策、债券供求等因素,持续研究债券市场运行状况、研判市场风险,制定债券投资策略,挖掘价值被低估的标的券种,力争实现超越业绩基准的投资收益。
业绩比较基准	中债综合(全价)指数收益率×80%+一年期定期存款利率(税后)×20%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金,其预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§3 基金运作情况

本基金经中国证券监督管理委员会《关于准予金鹰添鑫定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可【2018】1781号)文准予注册,由基金

管理人依照法律法规、《基金合同》等规定向社会公开募集。本基金基金合同于2018年12月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总数为1,009,999,000.00份。自2018年12月26日至2021年12月26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》等法律法规的规定和《基金合同》的有关规定,本基金基金合同生效之日起3年后的对应日,若基金资产净值低于2亿元,基金合同自动终止,且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。截至2021年12月26日日终,本基金的基金资产净值低于2亿元,已触发上述《基金合同》约定的自动终止情形,基金管理人将根据相关法律法规、基金合同等规定对本基金进行清算。本基金最后运作日为2021年12月26日,自2021年12月27日起,本基金进入基金财产清算程序。

§4 财务报告

基金最后运作日资产负债表(已经审计)

会计主体:金鹰添鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日:2021年12月26日

单位:人民币元

	最后运作日 2021年12月26日
资产:	
银行存款	332,365.76
结算备付金	140,097.64
存出保证金	5,817.08
交易性金融资产	8,393,820.00
其中:债券投资	8,393,820.00
应收证券清算款	1,300,242.55
应收利息	218,476.00
资产总计	10,390,819.03
负债:	
应付管理人报酬	2,158.38
应付托管费	719.47
其他负债	263,013.60
负债合计	265,891.45

所有者权益：	
实收基金	10,000,000.00
未分配利润	124,927.58
所有者权益合计	10,124,927.58
负债和所有者权益总计	10,390,819.03

注：1、报告截止日2021年12月26日（本基金最后运作日），基金份额净值为1.0125元，基金份额为10,000,000.00份，资产净值为10,124,927.58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。本基金已将账面价值高于预计可收回金额的资产调整至预计可收回金额，并按预计结算金额计量负债。同时，不对资产、负债进行流动与非流动的划分。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2021年12月27日至2022年1月19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：

5.1 清算费用

按照《金鹰添鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》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。

5.2 资产处置情况

（1）本基金最后运作日银行存款332,365.76元，是存储于基金托管人中信银行股份有限公司的活期银行存款。

（2）本基金最后运作日结算备付金为140,097.64元，该款项由中国证券登记结算有限公司收取并保管，截至清算结束日2022年1月19日余额为103,924.65元，该款项已于2022年2月8日划至基金托管户。

（3）本基金最后运作日存出保证金5,817.08元，是由中国证券登记结算公

司收取并保管的结算保证金。结算保证金每月调整一次，根据《结算保证金管理业务指南》，“中国证券登记结算有限责任公司于每月初第二个交易日，根据结算参与人对应结算备付金账户前6个月日均结算净额调整其结算互保金额度，但不低于初始结算保证金基数”，截至清算结束日2022年1月19日余额为4,582.25元，该款项将由基金管理人以自有资金先行垫付，供清盘分配使用。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产8,393,820.00元，均为交易类债券投资资产，本基金已于2022年1月18日完成全部交易性金融资产的变现。

(5) 本基金最后运作日应收证券清算款1,300,242.55元，该款项为中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券清算款，已于2021年12月27日划至基金托管户。

(6) 本基金最后运作日应收利息218,476.00元，其中应收活期银行存款利息33.40元，款项将由基金管理人以自有资金先行垫付，供清盘分配使用；应收结算备付金利息31.50元，款项将由基金管理人以自有资金先行垫付，供清盘分配使用；应收存出保证金利息1.30元，款项将由基金管理人以自有资金先行垫付，供清盘分配使用；应收债券利息218,409.80元，已于2021年12月27日、2021年12月29日、2022年1月17日及2022年1月18日卖出债券时结算入账。

5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为2,158.38元，该款项已于2022年1月6日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为719.47元，该款项已于2022年1月6日支付。

(3) 本基金最后运作日其他负债263,013.60元，其中24,656.40元为预提2021年审计费，扣除清算期间审计费20,000.00元，差额4,656.40元已于2022年1月19日冲回基金资产；238,357.20元为预提证券时报信息披露费，其中实际费用120,000.00元已于2022年1月17日支付，差额118,357.20元已于2022年1月19日冲回基金资产。清算期间审计费20,000.00元将于收到会计师事务所付费发票后进行支付。

5.4 清算期剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2021 年 12 月 26 日基金净资产	10,124,927.58
加：清算期间（2021-12-27 至 2022-1-19）收入	
利息收入-银行存款利息收入（注 1）	1,469.84
利息收入-结算备金利息收入（注 1）	128.52
利息收入-存出保证金利息收入（注 1）	5.54
利息收入-债券利息收入（注 2）	14,214.59
债券投资收益（注 3）	116,577.00
公允价值变动损益（注 4）	-114,831.90
其他收入（注 5）	123,013.60
减：清算期间（2021-12-27 至 2022-1-19）费用	
交易费用（注 6）	8.63
汇划手续费（注 7）	255.50
清算律师费（注 8）	6,000.00
二、2022 年 1 月 19 日基金净资产	10,259,240.64

注：（1）利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2021年12月27日至2022年1月19日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。活期银行存款利息由托管银行于每季度3月、6月、9月、12月21日结算入账，或在账户注销时一次性结清；结算备付金利息及存出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；

- （2）利息收入-债券利息收入系清算期间所持有债券投资的利息收入；
- （3）债券投资收益系清算期间卖出所持债券获得的差价收入；
- （4）公允价值变动损益系清算期间所持债券的公允价值变动损益；
- （5）其他收入系清算期间冲回的预提审计费及信息披露费；
- （6）交易费用为清算期间基金资产变现产生的交易费用；
- （7）汇划手续费为托管户划款转账产生的费用；
- （8）清算律师费为律师事务所收取的清算费用；

资产处置及负债清偿后，于清算结束日2022年1月19日本基金剩余财产为人民币10,259,240.64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。

清算结束日次日 2022 年 1 月 20 日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金产生的利息亦属份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，截至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金的利息中仍未收到的部分将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的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。

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。

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。

§6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 1、《金鹰添鑫定期开放债券型发起式证券投资基金清算审计报告》
- 2、《金鹰添鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金清算事宜之法律意见》

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人金鹰基金管理有限公司

客户服务电话：400-6135-888

金鹰添鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金财产清算小组

二〇二二年三月八日