

宝盈中债 3-5 年国开行债券指数 证券投资基金清算报告

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二三年二月二十日

清算报告公告日：二〇二三年二月二十一日

一、重要提示

宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2021 年 3 月 24 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2021〕943 号）进行募集，于 2021 年 12 月 2 日成立。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

鉴于市场环境的变化，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》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）的有关规定以及《宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，本基金于 2022 年 12 月 19 日至 2023 年 1 月 15 日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议并表决通过了《关于终止宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》。基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告详见 2023 年 1 月 17 日刊登在《证券时报》及基金管理人网站（<http://www.byfunds.com>）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上的《宝盈基金管理有限公司关于宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。

宝盈基金管理有限公司自 2023 年 1 月 17 日起根据相关法律法规、《基金合同》等规定履行基金财产清算程序。本基金最后运作日为 2023 年 1 月 16 日，自 2023 年 1 月 17 日起进入清算期。

基金管理人宝盈基金管理有限公司、基金托管人上海银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于 2023 年 1 月 17 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海源泰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	宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金
------	-------------------------

基金简称	宝盈中债 3-5 年国开行债券指数	
基金主代码	011958	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 2 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
基金最后运作日基金份额总额（运作日后有赎回确认）	19,763,605.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	宝盈中债 3-5 年国开 行债券指数 A	宝盈中债 3-5 年国开 行债券指数 C
下属分级基金的交易代码	011958	011959
基金最后运作日下属分级基金的份额总额	19,761,853.53 份	1,751.76 份

2、基金产品说明

投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数型基金，采用抽样复制和动态最优化的方法为主，选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的债券，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。本基金的投资策略主要包括资产配置策略和债券投资策略。
业绩比较基准	中债-3-5 年国开行债券指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为债券型指数基金，其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。 本基金为指数型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。

三、基金运作情况概述

宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2021 年 3 月 24 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金注册的批复》（证监许可（2021）943 号）进行募集。本基金自 2021 年 9 月 22 日起向社会公开募集，截至 2021 年 12 月 1 日，基金募集工作已顺利结束。本次募集净认购金额为 1,000,007,791.54 元人民币，有效认购户数为 222 户。认购资金在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 1.49 元，折算为基金份额分别计入基金份额持有人基金账户，归基金份额持有人所有。上述资金已于 2021 年 12 月 2 日全额划入本基金在托管人上海银行股份有限公司开立的宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券

投资基金托管专户。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资并向中国证监会备案，《宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 2 日正式生效。

鉴于市场环境的变化，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》的有关规定和《基金合同》的约定，本基金管理人以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，于 2023 年 1 月 16 日审议并表决通过了《关于终止宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

根据《宝盈基金管理有限公司关于宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，本基金最后运作日为 2023 年 1 月 16 日，自 2023 年 1 月 17 日起进入清算期。宝盈基金管理有限公司自 2023 年 1 月 17 日起根据相关法律法规、《基金合同》等规定履行基金财产清算程序。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按《基金合同》约定正常运作。

四、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 1 月 16 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	2023 年 1 月 16 日（基金最后运作日）
资 产：	
银行存款	7,386,497.25
结算备付金	-
存出保证金	244.49
交易性金融资产	45,837,006.58
其中：债券投资	45,837,006.58
资产合计：	53,223,748.32
负债和所有者权益	2023 年 1 月 16 日（基金最后运作日）
负 债：	
应付管理人报酬	3,585.29
应付托管费	1,195.10

应付销售服务费	-
应付赎回款	33,077,758.62
其他负债	53,691.84
负债合计：	33,136,230.85
所有者权益：	
实收基金	19,763,605.29
未分配利润	323,912.18
所有者权益合计：	20,087,517.47
负债和所有者权益总计：	53,223,748.32

注：报告截止日 2023 年 1 月 16 日（基金最后运作日），基金份额总额为 19,763,605.29 份；其中宝盈中债 3-5 年国开行债券指数 A 基金份额总额 19,761,853.53 份，基金份额净值 1.0164 元；宝盈中债 3-5 年国开行债券指数 C 基金份额总额 1,751.76 份，基金份额净值 1.0151 元。

五、清算情况

自 2023 年 1 月 17 日至 2023 年 2 月 16 日止的清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》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剩余财产中支付。

2、资产处置情况

（1）本基金最后运作日的银行存款为人民币 7,386,497.25 元，其中 7,382,405.32 元为存储于基金托管人上海银行股份有限公司的活期银行存款，4,091.93 元为应计活期银行存款利息；

（2）本基金最后运作日结算备付金为人民币 0.00 元；

（3）本基金最后运作日存出保证金为人民币 244.49 元，其中 244.08 元为存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金，于 2023 年 2 月 2 日转入本基金托管户，0.41 元为应计存出保证金利息；

（4）本基金最后运作日债券投资为人民币 45,837,006.58 元，包含应计利息人民币 1,218,006.58 元，该类资产于 2023 年 1 月 17 日全部变现，变现金额为人民币 45,858,276.58 元。

3、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 3,585.29 元, 该款项已于 2023 年 2 月 3 日支付;

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,195.10 元, 该款项已于 2023 年 2 月 3 日支付;

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 0.00 元;

(4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 33,077,758.62 元, 该款项已于 2023 年 1 月 18 日支付;

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 53,691.84 元, 其中:

应付 2023 年 1 月中央国债登记结算有限责任公司账户维护费为人民币 1,500.00 元, 该款项已于 2023 年 1 月 30 日支付;

应付审计费为人民币 52,191.84 元(其中, 归属于 2022 年的审计费为人民币 50,000.00 元), 该款项将于实际支付时扣除。

4、清算期间的剩余资产分配情况

单位: 人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2023 年 1 月 16 日基金净资产	20,087,517.47
加: 清算期间 (2023 年 1 月 17 日至 2023 年 2 月 16 日) 收入	34,020.79
其中: 利息收入-银行存款利息收入 (注 1)	13,160.63
利息收入-上海存出保证金利息收入 (注 1)	0.16
债券投资变现收益 (注 2)	20,860.00
减: 清算期间 (2023 年 1 月 17 日至 2023 年 2 月 16 日) 应付款项	45.00
其中: 银行汇划费 (注 3)	20.00
预估银行汇划费 (注 4)	25.00
二、清算结束日 (2023 年 2 月 16 日) 基金资产净值 (注 5)	20,121,493.26

注 1: 利息收入系以当前适用利率预估, 该金额可能与实际结息金额存在略微差异。

注 2: 债券投资变现收益为人民币 20,860.00 元, 债券投资变现的中央国债登记结算有限责任公司结算服务费为人民币 300.00 元, 于 2023 年 1 月 30 日支付, 中国外汇交易中心银行间交易手续费为人民币 110.00 元, 于 2023 年 2 月 2 日支付。

注 3: 2023 年 1 月产生的银行汇划费为人民币 20.00 元, 于 2023 年 2 月 1 日支付。

注 4: 预计后续划拨各款项将产生银行汇划费人民币 25.00 元, 该费用将于实际支付时扣除。

注 5: 资产处置及负债清偿后, 截至 2023 年 2 月 16 日本基金剩余财产为人民币 20,121,493.26 元, 根据本基金《基金合同》的约定, 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，按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。清算期结束日次日至清算款划出日前一日的资金账户孳生的利息归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，基金管理人可以在清算付款日以自有资金先行垫付上述未结息金额，供清盘分配使用，待实际资金到账后再返还基金管理人，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有，利息收入预估金额与实际结算金额的差额由基金管理人承担。

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，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根据《基金合同》的要求进行公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

- (1)《宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金清算审计报告》
- (2)《上海源泰律师事务所关于宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金清算事宜之法律意见》

2、存放地点

基金管理人的住所和/或办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的住所和/或办公场所或在基金管理人网站免费查阅。

宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金财产清算小组

2023 年 2 月 20 日（清算报告出具日期）