

农银汇理信用添利债券型证券投资基金清算报告

基金管理人:农银汇理基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

清算报告出具日:二〇二壹年贰月贰拾贰日

清算报告公告日:二〇二壹年肆月贰日

§1 重要提示

农银汇理信用添利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[2011]第 1981 号《关于核准农银汇理信用添利债券型证券投资基金募集的批复》核准,由农银汇理基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理信用添利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 971,758,783.95 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 215 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理信用添利债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 972,043,841.33 份基金份额,其中认购资金利息折合 285,057.38 份基金份额。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据市场环境变化,为更好地满足投资者需求,保护基金份额持有人的利益,基金管理人依据《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《农银汇理信用添利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”)的有关规定,以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会,审议通过了《关于终止农银汇理信用添利债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。根据基金份额持有人大会通过的议案及方案说明,本基金最后运作日为 2020 年 12 月 24 日,自 2020 年 12 月 25 日进入清算期。

由基金管理人农银汇理基金管理有限公司、基金托管人中信银行股份有限公司、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 2020 年 12 月 25 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。

§2 基金产品概况

基金简称	农银信用添利债券
基金主代码	660013

基金运作方式	契约型。本基金合同生效后一年内封闭运作，基金合同生效满一年后转为开放运作。
基金合同生效日	2012年6月19日
报告期末(2020年12月24日)基金份额总额	12,155,459.36份
投资目标	以信用类债券作为主要的投资标的，在严格控制风险的基础上，综合利用多种投资策略，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将有效结合“自上而下”的资产配置策略以及“自下而上”的债券精选策略，在综合判断宏观经济基本面、证券市场走势等宏观因素的基础上，灵活配置基金资产在各类资产之间的配置比例，并通过严谨的信用分析以及对券种收益水平、流动性的客观判断，综合运用多种投资策略，精选个券构建投资组合。同时，本基金会关注并积极参与股票一级市场中存在的投资机会，力争在保持基金总体风险水平不变前提下进一步增厚基金收益水平。
业绩比较基准	中债综合指数×95%+同期银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为较低风险、较低收益的债券型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§3 基金运作情况概述

农银汇理信用添利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[2011]第1981号《关于核准农银汇理信用添利债券型证券投资基金募集的批复》核准，由农银汇理基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理信用添利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集971,758,783.95元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第215号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《农银汇理信用添利债券型证券投资基金基金合同》于2012

年 6 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 972,043,841.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 285,057.38 份基金份额。自 2012 年 6 月 19 日至 2020 年 12 月 24 日期间，本基金按基金合同正常运作。

为适应市场环境变化，更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《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《农银汇理信用添利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，审议通过了《关于终止农银汇理信用添利债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。根据基金份额持有人大会通过的议案及方案说明，本基金最后运作日为 2020 年 12 月 24 日，自 2020 年 12 月 25 日进入清算期。

§4 财务报告

4.1 资产负债表 (已审计)

会计主体：农银汇理信用添利债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 24 日(基金最后运作日)

单位：人民币元

资产	本期末 2020 年 12 月 24 日 (基金最后运作日)	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	120,689.00	303,384.11
结算备付金	56,666.67	124,785.00
存出保证金	1,473.59	3,391.27
交易性金融资产	13,211,926.90	27,515,855.40
其中：债券投资	13,211,926.90	27,515,855.40
应收利息	226,833.24	417,147.84
应收申购款	-	7,253.48
资产总计	13,617,589.40	28,371,817.10
负债和所有者权益		
负债：		
卖出回购金融资产款	300,000.00	1,500,000.00
应付证券清算款	21.49	253.15
应付赎回款	3,952.46	114,374.14
应付管理人报酬	7,470.49	16,591.46
应付托管费	2,134.41	4,740.43

应付税费	808.54	2,010.30
应付利息	-	-126.57
其他负债	281,673.17	362,680.03
负债合计	596,060.56	2,000,522.94
所有者权益：		
实收基金	12,155,459.36	23,647,069.88
未分配利润	866,069.48	2,724,224.28
所有者权益合计	13,021,528.84	26,371,294.16
负债和所有者权益总计	13,617,589.40	28,371,817.10

注：

1. 报告截止日 2020 年 12 月 24 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.0712 元，基金份额总额 12,155,459.36 份。
2. 财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 24 日(基金最后运作日)止期间，比较财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日止期间。

4.2 利润表(已审计)

会计主体：农银汇理信用添利债券型证券投资基金

报告期间：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 24 日(基金最后运作日)

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 24 日 (基金最后运作日)	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入	420,617.05	2,099,489.35
利息收入	646,738.19	1,253,233.84
其中：存款利息收入	10,266.17	22,066.11
债券利息收入	631,223.66	1,202,003.19
买入返售金融资产收入	5,248.36	29,164.54
投资收益	64,378.92	841,717.23
其中：债券投资收益	64,378.92	841,717.23

公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-305,446.71	-31,417.12
其他收入	14,946.65	35,955.40
减：二、费用	282,063.69	548,768.37
管理人报酬	132,900.17	237,166.31
托管费	37,971.50	67,761.82
交易费用	340.15	905.13
利息支出	13,327.84	69,903.47
其中：卖出回购金融资产支出	13,327.84	69,903.47
税金及附加	2,131.33	3,334.17
其他费用	95,392.70	169,697.47
三、利润总额	138,553.36	1,550,720.98
减：所得税费用	-	-
四、净利润	138,553.36	1,550,720.98

注：财务报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师薛竞、赵钰出具了普华永道中天特审字(2021)第0303号标准无保留意见的审计报告。

§5 基金财产分配

自2020年12月25日至2021年2月22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，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 资产处置情况

5.1.1. 本基金最后运作日存出保证金金额 1,473.59 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。该款项于 2021 年 1 月 5 日调整为 1,163.89 元，于 2021 年 2 月 2 日调整为 1,836.72 元。

5.1.2. 本基金最后运作日结算备付金金额 56,666.67 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金。该款项于 2021 年 1 月 5 日调整为 56,499.30 元，于 2021 年 2 月 2 日调整为 12,000.00 元。

5.1.3. 本基金最后运作日交易性金融资产 13,211,926.90 元,为了保护基金份额持有人利益,截至 2021 年 1 月 12 日,本基金于基金最后运作日持有的交易性金融资产已全部卖出,扣除交易费用后的变现金额(含应收利息)为人民币 13,517,758.08 元。

5.1.4 本基金最后运作日应收利息为 226,833.24 元。其中应收债券利息 226,818.91 元,截至 2021 年 1 月 12 日该款项已于债券卖出时变现所得。应收活期银行存款利息为 6.47 元,应收结算备付金利息为 7.65 元,应收存出保证金利息金额为 0.21 元,上述款项预计将于 2021 年 3 月 22 日结息并于当日划入托管账户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付管理人报酬 7,470.49 元,该款项于 2021 年 1 月 5 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费 2,134.41 元,该款项于 2021 年 1 月 5 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日卖出回购金融资产款 300,000.00 元,该款项于 2020 年 12 月 25 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日其他负债 281,673.17 元。其中包括预提审计费用 49,000.00 元,该款项于 2021 年 2 月 8 日支付;应付赎回费 0.37 元,该款项于 2020 年 12 月 29 日付清;以前年度挂账的原应由债券发行人代扣代缴的债券利息所得税 232,672.80 元,截至 2021 年 2 月 22 日止,由于相关部门对该部分款项如何处置没有明确的规定,故本基金的基金管理人农银汇理基金管理有限公司参考行业实务操作,经托管行确认,不再将其继续确认为其他负债,并于清算期内全部确认为其他收入。

5.2.5 本基金最后运作日应付赎回款 3,952.46 元,该款项于 2020 年 12 月 29 日付清。

5.2.6 本基金最后运作日应付税费 808.54 元,该款项于 2021 年 1 月 14 日付清。

5.2.7 本基金最后运作日应付证券清算款 21.49 元,该款项于 2020 年 12 月 25 日付清。

5.3 清算期间(2020 年 12 月 25 日截止至 2021 年 2 月 22 日)的清算损益情况

5.3.1 截止至 2021 年 2 月 22 日的利息收入金额 26,120.41, 系计提的自 2020 年 12 月 24 日至 2021 年 2 月 22 日的存款利息收入、结算备付金利息收入、存出保证金利息收入、债券利息收入、买入返售金融资产收入。另外其它收入 232,672.80 元。

5.3.2 清算期间的债券的投资收益金额 80,784.76 元, 系本基金最后运作日持有的债券资产变现所得, 卖出债券的同时产生交易费用 36.91 元。其中债券公允价值变动损益金额 16,100.34 元, 系本基金最后运作日债券投资估值增值额。

5.3.3 清算期间产生的其他费用 49,000 元, 其中包括清算律师费 40,000.00 元, 中债和上清所账户销户时缴纳的账户维护费 9,000.00 元。

5.3.4 清算期间产生的利息支出金额 133.56 元, 系卖出回购金融资产利息支出。

5.3.5 清算期间产生的税金及附加金额 48.05 元。

5.3.6 按照《农银汇理信用添利债券型证券投资基金基金合同》的约定, 清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产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。

5.4 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
一、最后运作日 2020 年 12 月 24 日基金净资产	13,021,528.84
份额调整	-86,033.55
加: 申购款	0.00
减: 赎回款	86,033.55
加: 清算期间净收益	274,259.11
二、2021 年 2 月 22 日基金净资产	13,209,754.40

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。

资产处置及负债清偿后, 本基金截至 2021 年 2 月 22 日止的剩余净财产为 13,209,754.40 元。

截至 2021 年 2 月 22 日止,经基金管理人以及基金托管人确认,本基金托管账户银行存款余额共人民币 13,183,964.93 元,结算备付金 12,000.00 元,存出保证金 1,836.72 元,应收利息 11,952.75。清算过程中各项利息及费用与实际结算金额的尾差由管理人承担。

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,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。

§6 备查文件

6.1 备查文件目录

- 1、审计报告
- 2、法律意见书

6.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人网站 www.abccca.com, 中国证监会基金电子披露网站 <http://eid.csrc.gov.cn/fund>。

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

农银汇理信用添利债券型证券投资基金财产清算小组

清算报告出具日:2021 年 2 月 22 日

清算报告公告日:2021 年 4 月 2 日