

信达澳银安和纯债债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：信达澳银基金管理有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

清算报告出具日：2019年9月24日

一、 重要提示

信达澳银安和纯债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 2018 年 8 月 24 日《关于准予信达澳银安和纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2018】1383 号）注册公开募集，自 2019 年 3 月 11 日起基金合同生效，基金管理人为信达澳银基金管理有限公司，基金托管人为江苏银行股份有限公司。

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》、《信达澳银安和纯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，《基金合同》生效后，如本基金连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，本基金合同将终止并进行基金财产清算，且无需召开基金份额持有人大会，同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。根据《信达澳银基金管理有限公司关于信达澳银安和纯债债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》及《基金合同》，截至2019年9月16日，本基金已出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，已触发《基金合同》中约定的基金合同终止条款。根据《基金合同》的有关约定，《基金合同》将终止并依据基金财产清算程序进行财产清算，且无需召开基金份额持有人大会审议。本基金最后运作日为2019年9月17日，于2019年9月18日起进入清算期。

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）和上海源泰律师事务所于 2019 年 9 月 18 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海源泰律师事务所对清算事宜出具法律意见。

二、 基金概况

基金名称	信达澳银安和纯债债券型证券投资基金
基金简称	信达澳银安和纯债
基金代码	006391
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年3月11日
最后运作日基金份额总额(2019年9月17日)	71,999.34
投资目标	本基金在追求基金资产长期稳定的基础上,通过积极主动的管理,力争实现基金资产净值的持续、稳健增长。
投资范围	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券包括(国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券、次级债)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。</p> <p>本基金不直接买入股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券、可交换债券。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、</p>

	<p>应收申购款等。</p> <p>如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
投资策略	<p>本基金将采取自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的投资策略，通过对宏观经济、国家政策、信用主体评级水平等各种影响债券投资的因素细致深入的分析，确定债券组合资产在国债、金融债、信用债等品种之间的类属配置比例。在此基础上，综合运用久期策略、收益率曲线策略、回购套利策略和个券选择策略积极主动地进行资产投资组合的构建。在风险可控的前提下，力求基金资产的长期稳定增值。</p>
业绩比较基准	<p>中债综合全价（总值）指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%</p>
风险收益特征	<p>本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。</p>
基金管理人	<p>信达澳银基金管理有限公司</p>
基金托管人	<p>江苏银行股份有限公司</p>

三、基金运作情况

信达澳银安和纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证监会证监许可[2018]1383号文《关于准予信达澳银安和纯债债券型证券投资基金注册的批复》的注册,由信达澳银基金管理有限公司作为基金管理人向社会公开募集,基金合同于2019年3月11日生效。首次设立募集规模为200,096,701.42份基金份额。

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》、《信达澳银安和纯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,《基金合同》生效后,如本基金连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,本基金合同将终止并进行基金财产清算,且无需召开基金份额持有人大会,同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。根据《信达澳银基金管理有限公司关于信达澳银安和纯债债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》及《基金合同》,本基金最后运作日为2019年9月17日,于2019年9月18日起进入清算期。

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：信达澳银安和纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2019年9月17日

单位：人民币元

	最后运作日 2019年9月17日
资产：	
银行存款	48,757.47
结算备付金	134.82
存出保证金	-
交易性金融资产	126,970.20
其中：债券投资	126,970.20
应收利息	6,302.08
其他资产	-
资产总计	182,164.57
负债：	
应付赎回款	12,610.14
应付管理人报酬	28.03
应付托管费	9.35
应交税费	-
其他负债	32,229.47
负债合计	44,876.99
所有者权益：	
实收基金	71,999.34
未分配利润	65,288.24
所有者权益合计	137,287.58
负债和所有者权益总计	182,164.57

注：基金最后运作日2019年9月17日，信达澳银安和纯债债券型证券投资基金单位净值为1.9068元，份额为71,999.34份。

五、清算情况

自2019年9月18日至2019年9月24日止的清算期间,本基金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。基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下:

1、 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币134.82元,该款项将于清算款划出日由基金管理人信达澳银基金管理有限公司以自有资金垫付,基金管理人垫付的资金将于清算期后银行结息日后返还给基金管理人。

(2) 本基金最后运作日交易性金融资产人民币126,970.20元,其明细如下:

单位:人民币元

债券代码	债券名称	最后运作日 估值单价	数量 (单位:张)	最后运作日 成本总额	最后运作日 估值总额
108602	国开 1704	100.77	1,260	126,993.10	126,970.20

以上债券已于自2019年9月18日处置变现,实际变现金额为人民币129,003.30元。

(3) 本基金最后运作日应收利息人民币6,302.08元,包括应收银行存款利息人民币4,247.37元、应收债券利息人民币2,054.56元及应收备付金利息人民币0.15元。截至2019年9月24日应收利息余额为人民币11.42元,包括应收银行存款利息人民币11.38元及应收备付金利息人民币0.04元,该款项将于结息后划入本基金托管账户。

2、 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币12,610.14元,该款项已于2019年9月18日及2019年9月19日支付;

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币28.03元,该款项已于2019年9月20日支付;

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币9.35元,该款项已于2019年9月20日支付;

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币32,229.47元,其中银行间债券账户维

护费人民币9,227.78元，已于2019年9月24日支付；应付赎回费人民币1.69元，已于2019年9月18日支付；本基金预提审计费用人民币23,000.00元，其中人民币8,000.00元的清算审计费将于本次清算结束后支付，多预提人民币15,000.00元于清算期间冲销。

3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2019年9月18日至 2019年9月24日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入(注1)	31.65
2、投资收益	-55.66
3、公允价值变动损益	22.90
4、赎回费收入	6.05
5、其他收入(注2)	15,000.00
清算收入小计	15,004.94
二、清算费用	
1、交易费用	2.13
2、银行间账户服务费	72.22
3、律师费(注3)	15,000.00
清算费用小计(注4)	15,074.35
三、清算净收益	-69.41

注1：利息收入系计提自2019年9月18日至2019年9月24日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、债券利息。

注2：其他收入为冲销本基金多预提费用。

注3：律师费系预提的因清算所产生的律师费，该款项将于本次清算结束后支付。

注4：根据《信达澳银基金管理有限公司关于信达澳银安和纯债债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

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2019年9月17日基金净资产	137,287.58
加：清算期间净收益	-69.41
减：基金申购赎回净额 (于2019年9月18日确认的投资者申购赎回申请)	24,798.08
二、清算期结束日2019年9月24日基金净资产	112,420.09

资产处置及负债清偿后，于2019年9月24日本基金剩余财产为人民币112,420.09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。

因清算款划出日不能确定，暂不能准确预估清算结束日至清算款划出日前一日银行存款、结算备付金产生的利息，该期间利息亦属全体份额持有人所有，将与清算结束日净资产合计按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。由于本基金托管户银行存款、结算备付金按季度结息，基金管理人信达澳银基金管理有限公司将于清算款划出日以自有资金划入托管账户，用以垫付本基金最后运作日应收利息余额及清算起始日至清算款划出日(不含当日)产生的利息，具体垫付金额按当前适用的利率进行预估。基金管理人垫付的资金以及垫付日之后产生的利息将于清算期后银行结息日后返还给基金管理人。

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向基金份额持有人公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 《信达澳银安和纯债债券型证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《关于信达澳银安和纯债债券型证券投资基金清算事宜之法律意见》

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。

信达澳银安和纯债债券型证券投资基金财产清算小组

2019年12月24日