

农银汇理可转债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:中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日:二〇二零年十二月十四日

清算报告公告日:二〇二零年十二月二十四日

§1 重要提示

农银汇理可转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(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]第 1943 号《关于准予农银汇理可转债债券型证券投资基金注册的批复》注册,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《农银汇理可转债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 327,172,667.85 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0293 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理可转债债券型证券投资基金基金合同》于 2019 年 6 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 327,243,527.96 份基金份额,其中认购资金利息折合 70,860.11 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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《农银汇理可转债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,终止《基金合同》。鉴于农银汇理可转债债券型证券投资基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元,为维护基金份额持有人利益,根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定,《基金合同》生效后,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况的,基金管理人应当终止《基金合同》,并按照《基金合同》的约定程序进行清算,无需召开基金份额持有人大会。本基金管理人与基金托管人协商一致,决定本基金最后运作日为 2020 年 10 月 26 日,自 2020 年 10 月 27 日进入清算期。

由基金管理人农银汇理基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、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 10 月 27 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	农银可转债债券
基金主代码	007106
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年6月3日
报告期末(2020年10月26日)基金份额总额	7,631,199.13 份
投资目标	本基金主要通过投资于可转换债券品种，在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供长期稳定的回报。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、可转换债券和可交换债券投资策略；4、普通债券投资策略；5、权证投资策略；6、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×60%+中债综合财富（总值）指数收益率×30%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金，低于股票型、混合型基金。
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 基金运作情况概述

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[2018]第1943号《关于准予农银汇理可转债债券型证券投资基金注册的批复》注册,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《农银汇理可转债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 327,172,667.85元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0293号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理可转债债券型证券投资

资基金基金合同》于 2019 年 6 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 327,243,527.96 份基金份额,其中认购资金利息折合 70,860.11 份基金份额。自 2019 年 6 月 3 日至 2020 年 10 月 26 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《农银汇理可转债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,终止《农银汇理可转债债券型证券投资基金基金合同》。鉴于农银汇理可转债债券型证券投资基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元,为维护基金份额持有人利益,根据本基金基金合同的约定,不需召开基金份额持有人大会,本基金管理人与基金托管人协商一致,决定本基金最后运作日为 2020 年 10 月 26 日,自 2020 年 10 月 27 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: 农银汇理可转债债券型证券投资基金

报告截止日: 2020 年 10 月 26 日(基金最后运作日)

单位: 人民币元

资产	本期末 2020 年 10 月 26 日 (基金最后运作日)	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产:		
银行存款	980,586.74	587,854.37
结算备付金	4,949.79	575,352.14
存出保证金	2,376.21	9,273.79
交易性金融资产	8,785,787.23	21,982,899.23
其中:股票投资	421,680.00	1,844,350.00
债券投资	8,364,107.23	20,138,549.23
应收证券清算款	94,554.57	499,830.41
应收利息	36,073.24	83,710.56
应收申购款	33,207.43	43,764.99
资产总计	9,937,535.21	23,782,685.49
负债和所有者权益		
负债:		
卖出回购金融资产款	-	1,500,000.00
应付证券清算款	-	117,928.76
应付赎回款	312,942.07	1,926,650.29

应付管理人报酬	5,823.83	24,196.10
应付托管费	1,091.99	4,536.76
应付交易费用	294.27	27,292.24
应交税费	38.35	174.05
应付利息	-	-84.79
其他负债	41,088.76	110,004.91
负债合计	361,279.27	3,710,698.32
所有者权益:		
实收基金	7,631,199.13	18,486,722.69
未分配利润	1,945,056.81	1,585,264.48
所有者权益合计	9,576,255.94	20,071,987.17
负债和所有者权益总计	9,937,535.21	23,782,685.49

注:

1. 报告截止日 2020 年 10 月 26 日(基金最后运作日),基金份额净值 1.2549 元,基金份额总额 7,631,199.13 份。
2. 财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 10 月 26 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 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间。

4.2 利润表(已审计)

会计主体:农银汇理可转债债券型证券投资基金

报告期间:2020 年 1 月 1 日至 2020 年 10 月 26 日(基金最后运作日)

单位:人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 10 月 26 日 (基金最后运作日)	上年度可比期间 2019 年 6 月 3 日 (基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
一、收入	2,199,075.20	4,109,066.56
利息收入	110,640.69	1,166,958.62
其中:存款利息收入	11,838.76	765,424.04
债券利息收入	98,801.93	381,015.25
买入返售金融资产收入	-	20,519.33
投资收益	2,890,968.33	1,985,610.47
其中:股票投资收益	849,702.63	413,699.00
债券投资收益	2,025,889.70	1,558,473.39
股利收益	15,376.00	13,438.08
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-826,927.67	955,198.83
其他收入	24,393.85	1,298.64

减:二、费用	229,872.71	690,570.89
管理人报酬	113,191.07	403,941.01
托管费	21,223.33	75,738.98
交易费用	23,380.47	62,517.93
利息支出	8,704.15	27,639.25
其中: 卖出回购金融资产支出	8,704.15	27,639.25
税金及附加	84.28	105.69
其他费用	63,289.41	120,628.03
三、利润总额	1,969,202.49	3,418,495.67
减:所得税费用	-	-
四、净利润	1,969,202.49	3,418,495.67

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(2020)第 3220 号标准无保留意见的审计报告。

§5 基金财产分配

自 2020 年 10 月 27 日至 2020 年 12 月 14 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 2,376.21 元,为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算保证金,于 2020 年 11 月 3 日划入托管账户。

5.1.2. 本基金最后运作日结算备付金金额 4,949.79 元,为存放于中国证券登记结算有限责任公司的最低备付金。该款项于 2020 年 11 月 3 日调整为 573.13 元,最终于 2020 年 12 月 2 日划入托管账户。

5.1.3. 本基金最后运作日交易性金融资产为 8,785,787.23 元,为了保护基金份额持有人利益,截至 2020 年 10 月 28 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 8,812,597.14 元。

5.1.4 本基金最后运作日应收利息为 36,073.24 元。其中应收债券利息 35,701.15 元,截至 2020 年 10 月 28 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 350.11 元, 应收结算备付金利息为 17.71 元, 应收存出保证金利息金额为 4.27 元, 上述款项预计将于 2020 年 12 月 21 日结息并于当日划入托管账户。

5.1.5 本基金最后运作日应收申购款 33,207.43 元。该款项于 2020 年 10 月 27 日和 2020 年 10 月 28 日划入托管账户。

5.1.6 本基金最后运作日应收证券清算款 94,554.57 元。该款项于 2020 年 10 月 27 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 5,823.83 元, 该款项于 2020 年 11 月 4 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费 1,091.99 元, 该款项于 2020 年 11 月 4 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付交易费用 294.27 元, 该款项于 2020 年 11 月 3 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日预提费用 41,000.00 元。该费用为预提审计费 41,000.00 元, 该款项于 2020 年 11 月 26 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日应付赎回款 312,942.07 元, 该款项于 2020 年 10 月 29 日付清。

5.2.6 本基金最后运作日应交税费 38.35 元, 该款项于 2020 年 11 月 12 日付清。

5.2.7 本基金最后运作日应付赎回费 88.76 元, 该款项于 2020 年 10 月 28 日付清。

5.3 清算期间（2020 年 10 月 27 日截止至 2020 年 12 月 14 日）的清算损益情况

5.3.1 截止至 2020 年 12 月 14 日的利息收入金额 4,557.26, 系计提的自 2020 年 10 月 27 日至 2020 年 12 月 14 日的活期银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息、债券利息收入。另外其它收入 0 元, 股利收入-286.00 元, 合计 4,271.26 元。

5.3.2 清算期间的股票和债券的投资收益金额 119,729.13 元, 系本基金最后运作日持有的股票和债券资产变现所得, 卖出股票和债券的同时产生交易费用

924.18 元。其中股票公允价值变动损益金额 40,642.80 元，债券公允价值变动损益金额-168,913.96 元，系本基金最后运作日股票和债券投资估值增值额。

5.3.3 清算期间产生的其他费用 18,101.00 元，其中包括清算律师费 18,000.00 元，101 元系清算期间产生的银行费用。

5.3.4 清算期间产生的利息支出金额 0 元。

5.3.5 清算期间产生的税金及附加金额 0.24 元。

5.3.6 按照《农银汇理可转债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 10 月 26 日基金净资产	9,576,255.94
份额调整	-28,493.21
加：申购款	12,517.28
减：赎回款	41,010.49
加：清算期间净收益	-23,296.19
二、2020 年 12 月 14 日基金净资产	9,524,466.54

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 2020 年 12 月 14 日止的剩余净资产为 9,524,466.54 元。

截至 2020 年 12 月 14 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 9,519,718.44 元，结算备付金 0 元，存出保证金 0 元。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.abc-ca.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。

农银汇理可转债债券型证券投资基金财产清算小组

清算报告出具日:2020年12月14日

清算报告公告日:2020年12月24日