

农银汇理永益定期开放混合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:中国银行股份有限公司

清算报告出具日:二零二一年三月二十二日

清算报告公告日:二零二一年四月十七日

§1 重要提示

农银汇理永益定期开放混合型证券投资基金(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[2017]第 1001 号《关于准予农银汇理永益定期开放混合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《农银汇理永益定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。募集期结束经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具德师报(验)字(17)第 00486 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。《农银汇理永益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 11 月 2 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司,登记机构为农银汇理基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

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《农银汇理永益定期开放混合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》。鉴于农银汇理永益定期开放混合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,在任一开放期的最后一个开放日日终,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审议。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 11 月 25 日,自 2020 年 11 月 26 日进入清算期。

由基金管理人农银汇理基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于 2020 年 11 月 26 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由德勤华永会计师事务所(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	农银永益定开混合
基金主代码	005061
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年11月2日
报告期末(2020年11月25日)基金份额总额	37,545,679.91份
投资目标	本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，追求实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金基于对宏观经济、政策面、市场面等因素的综合分析，结合对股票、债券、现金等大类资产的收益特征的前瞻性研究，形成对各类别资产未来表现的预判，自上而下调整基金大类资产配置。在严格控制投资组合风险的前提下，确定和调整基金资产中股票、债券、货币市场工具以及其他金融工具的配置比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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[2017]

第 1001 号《关于准予农银汇理永益定期开放混合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《农银汇理永益定期开放混合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 279,383,247.64 元,业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(17)第 00486 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理永益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 11 月 2 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 279,568,355.98 份基金份额,其中认购资金利息折合 185,108.34 份基金份额。自 2017 年 11 月 2 日至 2020 年 11 月 25 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《农银汇理永益定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,终止《农银汇理永益定期开放混合型证券投资基金基金合同》。鉴于农银汇理永益定期开放混合型证券投资基金在第三个开放期的最后一个开放日(2020 年 11 月 24 日)日终的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审议,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 11 月 25 日,自 2020 年 11 月 26 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:农银汇理永益定期开放混合型证券投资基金

清算资产负债表

2020年11月26日(清算开始日)至2021年3月22日(清算结束日)

单位:人民币元

清算资产负债表

单位：人民币元

项目	2020年11月25日 (最后运作日)	2021年3月22日 (清算结束日)
资产：		
银行存款	625,872.44	40,902,815.60
结算备付金	162,556.74	-
存出保证金	4,060.60	-
交易性金融资产	36,705,674.00	-
其中：股票投资	2,537,384.00	-
债券投资	34,168,290.00	-
应收证券清算款	7,445,668.53	-
应收利息	685,952.05	397.66
应收申购款	9.99	-
资产总计	45,629,794.35	40,903,213.26
负债和所有者权益		
负债：		
应付赎回款	4,745,016.97	-
应付管理人报酬	54,210.25	-
应付托管费	9,035.02	-
应付交易费用	10,021.31	-
应付税费	4,010.72	-
其他负债	108,000.00	-
负债合计	4,930,294.27	-
所有者权益：		
实收基金	37,545,679.91	37,545,679.91
未分配利润	3,153,820.17	3,357,533.35
所有者权益合计	40,699,500.08	40,903,213.26
负债和所有者权益总计	45,629,794.35	40,903,213.26

注：农银汇理永益定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)最后运作日2020年11月25日，本基金份额净值1.0840元，基金份额总额37,545,679.91份。

清算损益表

2020年11月26日(清算开始日)至2021年3月22日(清算结束日)止期间

清算损益表

单位：人民币元

项目	2020年11月26日(清算开始日) 至2021年3月22日(清算结束日)止 期间
一、收入	236,780.77
1、利息收入(损失以“-”填列)	53,917.91
其中：存款利息收入	45,614.73
债券利息收入	4,423.73
买入返售金融资产收入	3,879.45
2、投资收益(损失以“-”填列)	434,034.85
其中：股票投资收益	415,280.78
债券投资收益	20,177.32
股利收益	-1,423.25
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)	-251,171.99
4、其他收入(损失以“-”填列)	-
减：二、费用	33,067.59
1、管理人报酬	-
2、基金托管费	-
3、交易费用	5,341.77
4、利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
5、税金及附加	15.92
6、其他费用	27,709.90
三、利润总额	203,713.18
减：所得税费用	-
四、净收益	203,713.18

注：财务报告已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师汪芳、蔡程琳出具了德师报（审）字（21）第 S00191 号标准无保留意见的审计报告。

§5 基金财产分配

自2020年11月26日至2021年3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为人民币 4,060.60 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,该款项于 2020 年 12 月 2 日调整为人民币 10,665.21 元,最终于 2021 年 1 月 5 日划入托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金为人民币 162,556.74 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 12 月 2 日调整为人民币 660,542.99 元,2021 年 1 月 5 日调整为人民币 316.96 元,最终于 2021 年 2 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人民币 36,705,674.00 元,为了保护基金份额持有人利益,截至 2020 年 12 月 24 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 37,570,967.00 元。

5.1.4 本基金最后运作日应收利息为人民币 685,952.05 元。其中应收债券利息为人民币 681,998.46 元,该款项为截止至 2020 年 11 月 27 日卖出所有债券变现所得。应收活期存款利息为人民币 766.11 元,应收结算备付金利息为人民币 3,173.80 元,应收存出保证金利息金额为人民币 13.68 元,上述款项于 2021 年 3 月 22 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为人民币 9.99 元。该款项于 2020 年 11 月 26 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为人民币 7,445,668.53 元。该款项于 2020 年 11 月 26 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为人民币 54,210.25 元,该款项已于 2020 年 12 月 3 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 9,035.02 元,该款项已于 2020 年 12 月 3 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 10,021.31 元,该款项已于

2021年1月20日支付。

5.2.4 本基金最后运作日其他负债为人民币108,000.00元,包括预提审计费、中证报信息披露费。其中预提审计费为人民币36,000.00元、预提中证报信息披露费为人民币72,000.00元。中证报信息披露费已于2021年2月9日支付,审计费已于2021年2月10日支付。

5.2.5 本基金最后运作日应付赎回款为人民币4,745,016.97元,该款项已于2020年11月27日支付。

5.2.6 本基金最后运作日应交税费为人民币4,010.72元,该款项已于2020年12月7日支付。

5.3 清算期间(2020年11月26日至2021年3月22日)的清算损益情况

5.3.1 清算期间的利息收入金额为人民币53,917.91元,系计提的自2020年11月26日至2021年3月22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、买入返售金融资产收入。

5.3.2 清算期间的投资收益金额为人民币434,034.85元,其中股票投资收益金额为人民币415,280.78元,债券投资收益金额为人民币20,177.32元,系本基金最后运作日持有的股票、债券资产变现所得,卖出股票和债券的同时共产生交易费用为人民币5,341.77元。另外股利收入为人民币-1,423.25元。

5.3.3 清算期间的公允价值变动损益为人民币-251,171.99元,其中股票公允价值变动损益金额为人民币-412,743.38元,债券公允价值变动损益金额为人民币161,571.39元,系本基金最后运作日所持有的股票和债券投资估值增值变动额。

5.3.4 清算期间产生的其他费用为人民币27,709.90元,其中包括清算律师费人民币18,000元,中债账户维护费人民币4,500.00元,上清所账户维护费人民币4,800.00元,银行费用人民币409.90元。

5.3.5 清算期间的税金及附加金额为人民币15.92元。

5.3.6 按照《农银汇理永益定期开放混合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 11 月 25 日基金净资产	40,699,500.08
份额调整	0
加:申购款	0
减:赎回款	0
加:清算期间净收益	203,713.18
二、2021 年 3 月 22 日基金净资产	40,903,213.26

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 3 月 22 日止的剩余净财产为 40,903,213.26 元。

截至 2021 年 3 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 40,902,815.60 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。

农银汇理永益定期开放混合型证券投资基金财产清算小组

清算报告出具日:2021年3月22日

清算报告公告日:2021年4月17日