

农银汇理永乐 3 个月持有期混合型
基金中基金（FOF）
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：上海浦东发展银行股份有限公司

清算报告出具日：二零二三年三月十三日

清算报告公告日：二零二三年三月十八日

§1 重要提示

农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）的募集申请经中国证监会 2020 年 2 月 19 日证监许可【2020】285 号文注册，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《农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 437,672,130.43 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（2020）第 0465 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》于 2020 年 6 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 437,872,936.10 份基金份额，其中认购资金利息折合 200,805.67 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含 QDII 基金、香港互认基金）、国内依法发行上市的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准、注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单以及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相关规定）。本基金的投资组合比例为：投资于证券投资基金（含 QDII 基金、香港互认基金）的比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）占基金资产的比例为 0%-40%。每个交易日日终应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为： $25\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+75\% \times$ 中证全债指数收益率。

根据《农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》以及基金管理人农银汇理基金管理有限公司于 2022 年 12 月 6 日发布的《农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）发生基金合同终止情形及基金财产清算的公告》，本基金的最后运作日为 2022 年 12 月 5 日，并自 2022 年 12 月 6 日起进入清算期。

由基金管理人农银汇理基金管理有限公司、基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司、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 2022 年 12 月 6 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	农银永乐3月持有（FOF）
基金主代码	009185
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年6月24日
最后运作日（2022年12月5日）基金份额总额	21,513,515.33份
投资目标	本基金是基金中基金，通过大类资产配置，灵活投资于多种具有不同风险收益特征的基金，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	资产配置策略：以宏观经济分析为重点，基于经济结构调整过程中相关政策与法规的变化、证券市场环境、金融市场利率变化、经济运行周期、投资者情绪以及证券市场不同类别资产的估值及风险收益状况等，判断宏观经济发展趋势、政策导向和证券市场的未来发展趋势，确定和构造合适的资产配置比例。基金选择策略：采用定量分析和定性分析相结合的方法对基金进行选择。
业绩比较基准	25%×沪深 300 指数收益率+75%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

§3 基金运作情况概述

农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）的募集申请经中国证监会 2020 年 2 月 19 日证监许可【2020】285 号文注册，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《农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 437,672,130.43 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（2020）第 0465 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》于 2020 年 6 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 437,872,936.10 份基金份额，其中认购资金利息折合 200,805.67 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含 QDII 基金、香港互认基金）、国内依法发行上市的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准、注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单以及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相关规定）。本基金的投资组合比例为：投资于证券投资基金（含 QDII 基金、香港互认基金）的比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）占基金资产的比例为 0%-40%。每个交易日日终应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为： $25\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 75\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

根据《农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》以及基金管理人农银汇理基金管理有限公司于 2022 年 12 月 6 日发布的《农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）发生基金合同终止情形及基金财产清算的公告》，本基金的最后运作日为 2022 年 12 月 5 日，并自 2022 年 12 月 6 日起进入清算期。

§4 财务报告

4.1 资产负债表（已审计）

会计主体：农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2022 年 12 月 5 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2022 年 12 月 5 日 (基金最后运作日)	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	1,802,161.14	744,173.53
结算备付金	5,782.12	93,186.82
存出保证金	3,976.01	3,963.52
交易性金融资产	22,065,542.68	47,932,799.85
其中：基金投资	20,439,011.17	43,731,539.85
债券投资	1,626,531.51	4,201,260.00
应收清算款	1,867,739.86	13,065.73
应收申购款	516.68	547.42
其他资产	-	69,227.45
资产总计	25,745,718.49	48,856,964.32
负债和净资产		
负债：		
卖出回购金融资产款	-	1,200,000.00
应付清算款	-	-
应付赎回款	3,802,795.30	399,801.80
应付管理人报酬	3,515.61	44,759.06
应付托管费	813.62	10,391.23
应交税费	-	5,992.50
其他负债	96,000.00	169,457.53
负债合计	3,903,124.53	1,830,402.12
净资产：		
实收基金	21,513,515.33	43,747,833.16
未分配利润	329,078.63	3,278,729.04
净资产合计	21,842,593.96	47,026,562.20
负债和净资产总计	25,745,718.49	48,856,964.32

注：

1. 报告截止日 2022 年 12 月 5 日（基金最后运作日），基金份额净值 1.0153 元，基金份额总额 21,513,515.33 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 5 日（基金

最后运作日)止期间。

4.2 利润表(已审计)

会计主体:农银汇理永乐3个月持有期混合型基金中基金(FOF)

报告期间:2022年1月1日至2022年12月5日(基金最后运作日)

单位:人民币元

项目	本期 2022年1月1日至 2022年12月5日 (基金最后运作日)	上年度可比期间 2021年1月1日至 2021年12月31日
一、营业总收入	-2,042,700.87	4,654,323.75
1.利息收入	9,334.00	215,465.47
其中:存款利息收入	9,334.00	27,995.44
债券利息收入	-	187,470.03
2.投资收益(损失以“-”号填列)	-650,008.43	12,561,612.34
其中:基金投资收益	-1,243,425.82	11,845,618.10
债券投资收益	52,159.94	-33,290.71
股利收益	541,257.45	749,284.95
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-1,402,026.44	-8,122,754.06
减:二、营业总支出	648,452.64	1,587,386.95
1.管理人报酬	443,183.58	959,543.75
2.托管费	99,096.68	218,026.74
3.利息支出	7,102.05	14,968.47
其中:卖出回购金融资产支出	7,102.05	14,968.47
4.税金及附加	-	1,072.74
5.其他费用	99,070.33	393,775.25
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-2,691,153.51	3,066,936.80
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-2,691,153.51	3,066,936.80
五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	-2,691,153.51	3,066,936.80

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,注册会计师赵钰、罗佳出具了普华永道中天特审字(2023)第0403号标准无保留意见的审计报告。

§5 基金财产分配

本基金自 2022 年 12 月 6 日进入清算期,自 2022 年 12 月 6 日至 2023 年 3 月 13 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 本基金最后运作日活期存款为 1,802,161.14 元,含应计利息 1,351.97 元。应计活期存款利息于 2022 年 12 月 21 日结息并于当日划入托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金金额 5,782.12 元(含应计利息,下同),为存放于中国证券登记结算有限责任公司的最低备付金及应计利息,该款项于 2023 年 1 月 10 日划入托管账户,应计利息于 2022 年 12 月 21 日划入托管账户。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金金额 3,976.01 元(含应计利息,下同),为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金及应计利息,该款项于 2023 年 1 月 4 日划入托管账户,应计利息于 2022 年 12 月 21 日划入托管账户。

5.1.4 本基金最后运作日交易性金融资产 22,065,542.68 元(含应计利息,下同),为了保护基金份额持有人利益,截至 2022 年 12 月 7 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(含应计利息)为人民币 22,022,754.43 元。

5.1.5 本基金最后运作日应收证券清算款 1,867,739.86 元。该款项于 2022 年 12 月 7 日划入托管户。

5.1.6 本基金最后运作日应收申购款 516.68 元。该款项于 2022 年 12 月 8 日全部划入托管户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款 3,802,795.30 元, 于 2022 年 12 月 14 日全部支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬 3,515.61 元,于 2023 年 1 月 30 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费 813.62 元, 于 2023 年 1 月 30 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日其他负债 96,000.00 元。其中预提费用包括预提的审计费 50,000.00 元, 于 2023 年 1 月 30 日全部支付; 预提的信息披露费 46,000.00 元, 于 2023 年 1 月 30 日全部支付。

5.2.5 本基金最后运作日无应付交易费用。

5.2.6 本基金最后运作日无应付利息。

5.3 清算期间 (2022 年 12 月 6 日截止至 2023 年 3 月 13 日) 的清算损益情况

5.3.1 截止至 2023 年 3 月 13 日的利息收入金额 18,693.56 元,系计提的自 2022 年 12 月 6 日至 2023 年 3 月 13 日的存款利息收入、结算备付金利息收入和存出保证金利息收入。

5.3.2 清算期间的债券及基金的投资收益金额 76,149.02 元,其中包括本基金最后运作日持有的债券及基金资产变现所得 95,521.32 元,卖出债券及基金的交易费

用 19,372.30 元。清算期间的债券及基金公允价值变动损益金额-118,937.27 元，系本基金最后运作日债券及基金投资估值增值结转额。

5.3.3 清算期间的无其他收入。

5.3.4 清算期间产生的其他费用 18,167.84 元,其中包括清算律师费 18,000.00 元,银行汇划费 167.84 元。

5.3.5 清算期间净损益为-42,262.53 元。

5.3.6 按照《农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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	备注
一、最后运作日基金净资产	21,842,593.96	2022-12-5
二、清算期间基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,860,117.00	
加:申购款	297.62	
减:赎回款	1,860,414.62	
三、加:清算期间净收益（净亏损用负号表示）	-42,262.53	
四、清算报告出具日基金净资产	19,940,214.43	2023-3-13

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 2023 年 3 月 13 日止的剩余净财产为 19,940,214.43 元。

截至 2023 年 3 月 13 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 19,924,278.25 元,应计利息 15,928.46 元。清算备付金应计利息 5.2 元,存出保证金应计利息 2.52 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,及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。

农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金财产清算小组

清算报告出具日:2023 年 3 月 13 日

清算报告公告日:2023 年 3 月 18 日