

农银汇理金泰一年定期开放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:兴业银行股份有限公司

清算报告出具日:二〇二壹年陆月壹拾伍日

清算报告公告日:二〇二壹年柒月拾日

§1 重要提示

农银汇理金泰一年定期开放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[2016]第 2406 号《关于准予农银汇理金泰一年定期开放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《农银汇理金泰一年定期开放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 451,466,477.46 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(2016)第 1725 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 451,535,789.18 份基金份额,其中认购资金利息折合 69,311.72 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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金以定期开放方式运作,即采取封闭期和开放期相结合的方式运作。自基金合同生效日(含该日)起或者自每一开放期结束之日次日(含该日)起至一年后的对应日的期间,为本基金的一个封闭期。本基金的第一个封闭期自基金合同生效之日(含该日)起至一年后的对应日止。下一个封闭期自第一个开放期结束之日次日(含该日)起至一年后的对应日止,以此类推。如该对应日为非工作日或无该对应日,则顺延至下一工作日。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务(红利再投资除外),也不上市交易。

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》、《农银汇理金泰一年定期开放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,本基金触发基金合同终止情形。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。”本基金第四个开放期自 2021 年 2 月 10 日起，至 2021 年 3 月 2 日止。截至 2021 年 3 月 2 日日终，本基金资产净值不足 5000 万元，该情形已触发《基金合同》中约定的本基金终止条款。根据基金管农银汇理基金管理有限公司于 2021 年 3 月 4 日发布的《农银汇理金泰一年定期开放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》，本基金最后运作日为 2021 年 3 月 3 日。自 2021 年 3 月 4 日，本基金进入清算期。

由基金管理人农银汇理基金管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、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 2021 年 3 月 4 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	农银金泰定开债券
基金主代码	003691
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 27 日
报告期末(2021年3月3日)基金份额总额	30,306,064.75 份
投资目标	本基金主要通过投资于债券品种，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	（一）封闭期内投资策略包括： 1、宏观配置策略 宏观经济的运行状况是直接影响债券市场的重要因素，基金管理人将通过跟踪分析各项宏观经济指标的变化，考察宏观经济的变动趋势以及货币政策等对债券市场的影响。在此基础上，基金管理人将对未来短期、中期和长期债券市场的运行状况进行合

	<p>理分析，并建立对预期利率走势和证券价格走势的基本判断。对于债券市场的主要考察指标包括：远期利率水平、市场短期资金流向、央行公开市场操作力度、货币供应量变动等。</p> <p>2、期限配置策略</p> <p>为合理控制本基金开放期的流动性风险，并满足每次开放期的流动性需求，本基金在每个运作周期将适当的采取期限配置策略，即将基金资产所投资标的的平均剩余存续期与基金剩余运作周期进行适当的匹配。</p> <p>3、期限结构策略</p> <p>收益率曲线形状变化的主要影响因素是宏观经济基本面以及货币政策，而投资者的期限偏好以及各期限的债券供给分布对收益率形状有一定影响。对收益率曲线的分析采取定性和定量相结合的方法。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>（1）合理预计利率水平；（2）灵活调整组合久期；（3）科学配置投资品种；（4）谨慎选择个券。</p> <p>5、资产支持类证券投资策略。</p> <p>（二）开放期投资策略包括：</p> <p>在开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守 本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种， 防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p>
业绩比较基准	中证全债指数收益率×100%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于中低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，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	兴业银行股份有限公司

§3 基金运作情况概述

农银汇理金泰一年定期开放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[2016]第 2406 号《关于准予农银汇理金泰一年定期开放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《农银汇理金泰一年定期开放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 451,466,477.46 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(2016)第 1725 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 451,535,789.18 份基金份额,其中认购资金利息折合 69,311.72 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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金以定期开放方式运作,即采取封闭期和开放期相结合的方式运作。自基金合同生效日(含该日)起或者自每一开放期结束之日次日(含该日)起至一年后的对应日的期间,为本基金的一个封闭期。本基金的第一个封闭期自基金合同生效之日(含该日)起至一年后的对应日止。下一个封闭期自第一个开放期结束之日次日(含该日)起至一年后的对应日止,以此类推。如该对应日为非工作日或无该对应日,则顺延至下一工作日。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务(红利再投资除外),也不上市交易。

根据《农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》以及基金管理人农银汇理基金管理有限公司于 2021 年 3 月 4 日发布的《农银汇理金泰一年定期开放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》,本基金的最后运作日为 2021 年 3 月 3 日,并自 2021 年 3 月 4 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：农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021年3月3日(基金最后运作日)

单位：人民币元

资产	本期末 2021年3月3日 (基金最后运作日)	上年度末 2020年12月31日
资产：		
银行存款	19,221,248.10	208,135.60
结算备付金	1,446,018.16	8,405,496.33
存出保证金	15,971.54	1,801.34
交易性金融资产	9,137,400.00	275,289,381.10
其中：债券投资	9,137,400.00	275,289,381.10
应收证券清算款	13,790,612.17	672,087.17
应收利息	319,758.35	3,884,400.50
应收申购款	30,075.94	-
资产总计	43,961,084.26	288,461,302.04
负债和所有者权益		
负债：		
卖出回购金融资产款	-	90,430,000.00
应付证券清算款		702,241.83
应付赎回款	7,849,923.26	
应付管理人报酬	2,440.24	116,255.92
应付托管费	348.61	16,607.99
应付交易费用	862.50	687.58
应付税费	4,576.33	15,687.99
应付利息		-21,197.16
其他负债	198,493.38	170,000.00
负债合计	8,056,644.32	91,430,284.15
所有者权益：		
实收基金	30,306,064.75	167,948,241.86
未分配利润	5,598,375.19	29,082,776.03
所有者权益合计	35,904,439.94	197,031,017.89
负债和所有者权益总计	43,961,084.26	288,461,302.04

注：

1. 报告截止日2021年3月3日(基金最后运作日)，基金份额净值1.1847元，基金份额总额30,306,064.75份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 3 月 3 日(基金最后运作日)止期间。

4.2 利润表(已审计)

会计主体：农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金

报告期间：2021年1月1日至2021年3月3日(基金最后运作日)

项目	本期 2021年1月1日至 2021年3月3日 (基金最后运作日)	上年度可比期间 2020年1月1日至 2020年12月31日
一、收入	1,533,186.99	5,745,144.36
利息收入	1,111,760.90	8,377,928.04
其中：存款利息收入	23,908.37	147,816.95
债券利息收入	916,849.84	8,095,395.03
买入返售金融资产收入	171,002.69	134,716.06
投资收益	-991,379.61	462,058.73
其中：债券投资收益	-991,379.61	462,058.73
公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	1,412,805.20	-3,097,459.25
其他收入	0.50	2,616.84
减：二、费用	442,894.31	3,417,953.94
管理人报酬	202,251.85	1,325,077.11
托管费	28,893.09	189,296.84
交易费用	1,528.32	3,546.36
利息支出	168,626.88	1,667,534.97
其中：卖出回购金融资产支出	168,626.88	1,667,534.97
税金及附加	2,653.30	21,758.46
其他费用	38,940.87	210,740.20
三、利润总额	1,090,292.68	2,327,190.42
减：所得税费用	-	-

四、净利润	1,090,292.68	2,327,190.42
-------	--------------	--------------

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 2090 号标准无保留意见的审计报告。

§5 基金财产分配

自 2021 年 3 月 4 日至 2021 年 6 月 15 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 15,971.54 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 4 月 2 日调整为 18,103.17 元,于 2021 年 5 月 7 日调整为 16,184.61 元,于 2021 年 6 月 2 日调整为 16,168.95 元。

5.1.2. 本基金最后运作日结算备付金金额 1,446,018.16 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 4 月 2 日调整为 0 元。

5.1.3. 本基金最后运作日交易性金融资产 9,137,400.00 元,为了保护基金份额持有人利益,截至 2021 年 3 月 8 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 9,479,010.70 元。

5.1.4 本基金最后运作日应收利息为 319,758.35 元。其中应收债券利息 292,050.41 元,截至 2021 年 3 月 8 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 7,306.55 元,应收结算备付金利息为 20,393.87 元,应收存出保证金利息金额为 7.52 元,上述款项预计将于 2021 年 3 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 30,075.94 元。该款项于 2021 年 3 月 4 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 13,790,612.17 元。该款项于 2021 年 3 月 4 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 2,440.24 元, 该款项于 2021 年 4 月 6 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费 348.61 元, 该款项于 2021 年 4 月 6 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付交易费用 862.50 元, 该款项于 2021 年 4 月 12 日付清。

5.2.4 本基金最后运作日预提费用 198,493.38 元, 其中预提的审计费 58,493.38 于 2021 年 5 月 25 日付清, 预提的信息披露费 20,000.00 于 2021 年 6 月 15 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日应付赎回款 7,849,923.26 元, 该款项于 2021 年 3 月 5 日付清。

5.2.6 本基金最后运作日应付税费 4,576.33 元, 该款项于 2021 年 4 月 8 日付清。

5.3 清算期间（2021 年 3 月 4 日截止至 2021 年 6 月 15 日）清算损益情况

5.3.1 截止至 2021 年 6 月 15 日的利息收入金额 39,884.85 元, 系计提的自 2021 年 3 月 4 日至 2021 年 6 月 15 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。

5.3.2 清算期间的债券的投资收益金额 151,656.79 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 9.47 元。

5.3.3 清算期间产生的其他费用 27,913.53 元, 其中包括银行汇划费 613.53 元, 清算律师费 18,000.00 元, 中债和上清所账户销户时缴纳的账户维护费 9,300.00 元。

5.3.4 清算期间产生的债券公允价值变动损益金额-104,401.57 元, 系本基金债券投资估值增值额。

5.3.5 清算期间产生的税金及附加金额 8.09 元。

5.3.6 按照《农银汇理金泰一年定期开放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 2021 年 3 月 3 日基金净资产	35,904,439.94
二、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	0.00
加:申购款	0.00
减:赎回款	0.00
加:清算期间净收益	59,208.98
二、2021 年 6 月 15 日基金净资产	35,963,648.92

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 6 月 15 日止的剩余净财产为 35,963,648.92 元。

截至 2021 年 6 月 15 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 35,916,703.51 元,存出保证金 16,168.95 元,应收利息 30,776.46 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。

农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金财产清算小组

清算报告出具日:2021年6月15日

清算报告公告日:2021年7月10日