

农银汇理区间精选灵活配置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:中信银行股份有限公司

清算报告出具日:二〇二一年八月十九日

清算报告公告日:二〇二一年九月十八日

§1 重要提示

农银汇理区间精选灵活配置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[2018]533号《关于准予农银汇理周期资源灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和证监许可[2019]949号《关于准予农银汇理周期资源灵活配置型证券投资基金变更注册的批复》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《农银汇理区间精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。募集期结束经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具普华永道中天验字(2019)第0730号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。《农银汇理区间精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2019年12月10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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

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《农银汇理区间精选灵活配置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》。鉴于农银汇理区间精选灵活配置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,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。根据《基金合同》以及基金管理人于2021年5月26日发布的《农银汇理区间精选灵活配置混合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5月31日,自2021年6月1日进入清算期。

由基金管理人农银汇理基金管理有限公司、基金托管人中信银行股份有限公司、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

6月1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	农银区间精选混合
基金主代码	008078
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年12月10日
报告期末(2021年5月31日)基金份额总额	23,664,133.30份
投资目标	本基金通过调节组合的最大风险资产敞口，从而控制组合风险，实现组合锁定收益的目标。在组合风险敞口确定的前提下，基金管理人利用量化投资模型进行风险资产的配置，力争为投资者提供能获得一定程度超额收益的良好投资工具。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金的资产配置策略涉及股票和非股票类资产在投资组合中的配置比例严格按照纪律进行调整，随着参照指数的市盈率（PE）累积到一定阈值之后，本基金将按照纪律逐渐降低股票类资产配置比例，相应增加非股票类资产比例，从而确保基金能够部分锁定收益；在参照指数的市盈率下跌到下一个阈值的下限时，本基金将按照纪律逐渐增加股票资产配置比例，相应减少非股票类资产比例，从而为基金争取更大的潜在收益。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金的股票组合主要采用多因子模型进行构建，并根据投资限制、风险约束和交易成本的条件进行优化，包括：（1）多因子模型；（2）投资组合优化；（3）事件投资策略。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金债券投资管理将主要采取以下</p>

	<p>策略：（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；（5）期限结构策略。</p> <p>4、资产支持类证券投资策略</p> <p>5、股指期货投资策略</p>																		
业绩比较基准	<p>$I \times \text{中证 500 指数收益率} + (100\% - I) \times \text{中证全债指数收益率}$，其中 I 值在初期设定举例如下：</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>参考指数的市盈率 (PE)</th> <th>股票类资产比例 (S)</th> <th>业绩比较基准股票类资产比例参考值 (I)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>PE ≤ 18</td> <td>75% ≤ S < 95%</td> <td>75%</td> </tr> <tr> <td>18 < PE ≤ 25</td> <td>55% ≤ S < 75%</td> <td>55%</td> </tr> <tr> <td>25 < PE ≤ 35</td> <td>40% ≤ S < 55%</td> <td>40%</td> </tr> <tr> <td>35 < PE ≤ 45</td> <td>25% ≤ S < 40%</td> <td>25%</td> </tr> <tr> <td>PE > 45</td> <td>0% ≤ S < 25%</td> <td>0%</td> </tr> </tbody> </table>	参考指数的市盈率 (PE)	股票类资产比例 (S)	业绩比较基准股票类资产比例参考值 (I)	PE ≤ 18	75% ≤ S < 95%	75%	18 < PE ≤ 25	55% ≤ S < 75%	55%	25 < PE ≤ 35	40% ≤ S < 55%	40%	35 < PE ≤ 45	25% ≤ S < 40%	25%	PE > 45	0% ≤ S < 25%	0%
参考指数的市盈率 (PE)	股票类资产比例 (S)	业绩比较基准股票类资产比例参考值 (I)																	
PE ≤ 18	75% ≤ S < 95%	75%																	
18 < PE ≤ 25	55% ≤ S < 75%	55%																	
25 < PE ≤ 35	40% ≤ S < 55%	40%																	
35 < PE ≤ 45	25% ≤ S < 40%	25%																	
PE > 45	0% ≤ S < 25%	0%																	
风险收益特征	<p>本基金的风险和收益水平随着参考指数市盈率的不断上涨，风险不断下降，从而锁定前期收益。本基金的预期风险和收益在投资初始阶段属于较高水平；随着参考指数市盈率的不断上涨，本基金将逐步降低预期风险与收益水平，转变为中等风险的证券投资基金；在临近参考指数最高的市盈率以后，本基金将变为低风险的证券投资基金。</p>																		
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司																		
基金托管人	中信银行股份有限公司																		

§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]533号《关于准予农银汇理周期资源灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和证监许可[2019]949号《关于准予农银汇理周期资源灵活配置型证券投资基金变更注册的批复》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 524,939,257.06 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 0730 号验

资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理区间精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2019年12月10日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为525,221,090.63份基金份额,其中认购资金利息折合281,833.57份基金份额。2019年12月10日至2021年5月31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《农银汇理区间精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,终止《农银汇理区间精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。鉴于农银汇理区间精选灵活配置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,根据本基金基金合同的约定,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,不需召开基金份额持有人大会。根据基金合同以及基金管理人于2021年5月26日发布的《农银汇理区间精选灵活配置混合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5月31日,自2021年6月1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:农银汇理区间精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2021年5月31日(基金最后运作日)

单位:人民币元

资产	本期末 2021年5月31日 (基金最后运作日)	上年度末 2020年12月31日
资产:		
银行存款	8,135,423.91	7,501,946.41
结算备付金	208,463.60	457,976.66
存出保证金	28,393.75	58,727.29
交易性金融资产	24,477,062.11	51,541,752.13
其中:股票投资	22,214,383.51	43,842,586.93
债券投资	2,262,678.60	7,699,165.20
应收证券清算款	7,698,662.68	-
应收利息	48,012.72	49,500.50

应收申购款	1,845.25	63,171.10
资产总计	40,597,864.02	59,673,074.09
负债和所有者权益		
负债：		
应付证券清算款	680.50	-
应付赎回款	1,446,112.38	7,151,429.35
应付管理人报酬	54,144.52	73,750.71
应付托管费	9,024.07	12,291.77
应付交易费用	19,493.47	54,461.88
应交税费	43.83	85.73
其他负债	57,027.32	179,140.85
负债合计	1,586,526.09	7,471,160.29
所有者权益：		
实收基金	23,664,133.30	32,536,322.99
未分配利润	15,347,204.63	19,665,590.81
所有者权益合计	39,011,337.93	52,201,913.80
负债和所有者权益总计	40,597,864.02	59,673,074.09

注：报告截止日 2021 年 5 月 31 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.6485 元，基金份额总额 23,664,133.30 份。

4.2 利润表(已审计)

会计主体：农银汇理区间精选灵活配置混合型证券投资基金

报告期间：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 5 月 31 日(基金最后运作日)

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 5 月 31 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	1,231,161.48	49,081,336.84
利息收入	91,941.24	657,130.64
其中：存款利息收入	16,319.60	427,399.21
债券利息收入	33,373.18	73,370.59
买入返售金融资产收入	42,248.46	156,360.84
投资收益	8,850,407.01	31,911,145.38
其中：股票投资收益	7,833,090.08	31,316,807.18
债券投资收益	963,417.07	136,615.19
股利收益	53,899.86	457,723.01
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-7,769,090.50	14,499,793.00

其他收入	57,903.73	2,013,267.82
减：二、费用	502,513.74	3,102,221.26
管理人报酬	294,258.45	1,857,164.08
托管费	49,043.10	309,527.24
交易费用	104,585.60	761,144.38
税金及附加	27.86	16.02
其他费用	54,598.73	174,369.54
三、利润总额	728,647.74	45,979,115.58
减：所得税费用	-	-
四、净利润	728,647.74	45,979,115.58

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 2811 号标准无保留意见的审计报告。

§5 基金财产分配

自 2021 年 6 月 1 日至 2021 年 8 月 19 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 28,393.75 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 6 月 2 日调整为 26,977.21 元,于 2021 年 7 月 2 日调整为 29,224.28 元,于 2021 年 8 月 3 日调整为 23,679.05 元。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金金额 208,463.60 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 6 月 2 日调整为 370,801.07 元,于 2021 年 7 月 2 日调整为 0。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产 24,477,062.11 元,为了保护基金份额持有人利益,截至 2021 年 6 月 22 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为人民币 24,398,846.44 元。本基金于最后运作日前参与网下认购申请的新股分别于 2021 年 6 月 2 日,2021 年 6 月 9 日和 2021 年 6 月 15 日获得确认,认购成本合计 42,555.00 元,上述新股已于 2021 年 7 月 7 日前全部卖出,收回金额合计 66,808.63 元。

5.1.4 本基金最后运作日应收证券清算款 7,698,662.68 元。该款项于 2021 年 6 月 1 日划入托管账户。

5.1.5 本基金最后运作日应收利息 48,012.72 元。其中应收债券利息 42,637.15 元，截至 2021 年 6 月 2 日该款项已于债券卖出时变现所得；应收活期存款利息为 4,265.15 元，应收结算备付金利息为 1,002.69 元，应收存出保证金利息金额为 107.73 元，上述款项已于 2021 年 6 月 21 日结息并于当日划入托管账户。

5.1.6 本基金最后运作日应收申购款 1,845.25 元。该款项于 2021 年 6 月 1 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 54,144.52 元，该款项于 2021 年 6 月 3 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费 9,024.07 元，该款项于 2021 年 6 月 3 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付交易费用 19,493.47 元，该款项于 2021 年 7 月 12 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日其他负债 57,027.32 元。其中预提费用 54,000.00 元，包括预提信息披露费 33,000.00 元，该款项于 2021 年 6 月 15 日付清；预提审计费 21,000.00 元，该款项于 2021 年 8 月 3 日付清；应付赎回费 3,027.32 元，该款项于 2021 年 6 月 3 日付清。

5.2.5 本基金最后运作日应付赎回款 1,446,112.38 元，该款项于 2021 年 6 月 2 日付清。

5.2.6 本基金最后运作日应付证券清算款 680.50 元，该款项于 2021 年 6 月 1 日付清。

5.2.7 本基金最后运作日应交税费 43.83 元，该款项于 2021 年 6 月 11 日付清。

5.3 清算期间（2021 年 6 月 1 日截止至 2021 年 8 月 19 日）的清算损益情况

5.3.1 截止至 2021 年 8 月 19 日的利息收入金额 60,764.99 元，系计提的自 2021 年 6 月 1 日至 2021 年 8 月 19 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。

5.3.2清算期间的投资收益金额6,676,209.02元,系本基金最后运作日持有的交易性金融资产变现所得,卖出的同时产生交易费用42,238.95元。其中股票投资收益金额6,675,204.22元,债券投资收益金额1,004.80元,公允价值变动损益金额-6,730,702.50元,系本基金最后运作日交易性金融资产投资估值增值额。另外股利收益2,301.41元。

5.3.3清算期间的其他收入996.09元。

5.3.4清算期间已产生的其他费用737.35元,为银行汇划费737.35元。

5.3.5按照《农银汇理区间精选灵活配置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

项目	金额
一、最后运作日 2021 年 5 月 31 日基金净资产	39,011,337.93
份额调整	-527,886.21
加:申购款	10,411.69
减:赎回款	538,297.90
加:清算期间净收益	-33,407.29
二、2021 年 8 月 19 日基金净资产	38,450,044.43

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 8 月 19 日止的剩余净财产为 38,450,044.43 元。

截至 2021 年 8 月 19 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 38,380,880.26 元,存出保证金 23,679.05 元,应收利息 45,485.12 元。另外有清算律师费 18,000.00 元,截止至 2021 年 8 月 19 日,该款项尚未支付,待收到发票再行支付。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。

农银汇理区间精选灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

清算报告出具日:2021年8月19日

清算报告公告日:2021年9月18日