

金鹰添荣纯债债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二三年一月十八日

清算报告公告日：二〇二三年三月十四日

§1 重要提示

金鹰添荣纯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(简称"中国证监会")【2016】2813号文准予注册,《金鹰添荣纯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")于2017年3月7日起生效。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司(以下简称"基金管理人"),基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称"基金托管人")。

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》等法律法规的规定和《基金合同》的有关规定,本基金基金份额持有人大会于2022年12月23日表决通过的《关于金鹰添荣纯债债券型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》以及金鹰基金管理有限公司于2022年12月24日发布的《金鹰添荣纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》,本基金的最后运作日为2022年12月28日,自2022年12月29日起,本基金进入财产清算程序。

2023年1月6日为本基金清算结束日。由基金管理人、基金托管人、毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)和广东岭南律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,广东岭南律师事务所对清算事宜出具法律意见。

§2 基金概况

基金简称	金鹰添荣纯债债券
基金主代码	004033
交易代码	004033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月7日
最后运作日(2022-12-28) 基金份额总额	89,094.62 份
最后运作日(2022-12-28) 基金净值	76,599.89 元
投资目标	在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金主要投资于固定收益类金融工具,在充分考虑基金资产的安全性、收益性及流动性及严格控制风险的前提下,通过分析经济周期变化、货币政策、债券供求等因素,持续研究债券市场运行状况、研判市场风险,制定债券投资策略,挖掘价值被低估的标的券种,力争实现超越业绩基准的投资收益。
业绩比较基准	中债综合(全价)指数收益率×80%+一年期定期存款利率(税后)×20%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金,属于较低预期收益、较低预期风险的证券投资基金品种,其预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

§3 基金运作情况

本基金经中国证券监督管理委员会《关于准予金鹰添荣纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】2813号文）准予注册，由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定向社会公开募集。本基金基金合同于2017年3月7日正式生效，基金合同生效日基金份额总额为200,001,535.16份。自2017年3月7日至2022年12月28日期间，本基金按《基金合同》约定正常运作。

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》等法律法规的规定和《基金合同》的有关规定，本基金基金份额持有人大会于2022年12月23日表决通过的《关于金鹰添荣纯债债券型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》以及金鹰基金管理有限公司于2022年12月24日发布的《金鹰添荣纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，本基金的最后运作日为2022年12月28日，自2022年12月29日起，本基金进入财产清算程序。

§4 财务报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：金鹰添荣纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2022年12月28日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2022年12月28日
资产：	
银行存款	6,416.93
存出保证金	71.71
交易性金融资产	100,640.16
其中：债券投资	100,640.16
资产总计	107,128.80
负债：	
应付管理人报酬	21.72
应付托管费	7.17
应付销售服务费	0.02
其他负债	30,500.00
负债合计	30,528.91
净资产：	
实收基金	89,094.62
未分配利润	-12,494.73
净资产合计	76,599.89
负债和净资产总计	107,128.80

注：1、报告截止日2022年12月28日（本基金最后运作日），基金份额总额89,094.62份。其中金鹰添荣纯债债券A类基金的基金份额净值0.8616元，基金份额87,785.55份，资产净值75,639.63元；金鹰添荣纯债债券C类基金的基金份额净值0.7335元，基金份额1,309.07份，资产净值960.26元。

2、本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。本基金已将账面价值高于预计可收回金额的资产调整至预计可收回金额，并按预计结算金额计量负债。同时，不对资产、负债进行流动与非流动的划分。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

§5 清算情况

自2022年12月29日至2023年1月6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 清算费用

按照《金鹰添荣纯债债券型证券投资基金基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，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。

5.2 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款总额6,416.93元，其中6,415.88元是存储于基金托管人平安银行股份有限公司的活期银行存款，1.05元为应收活期银行存款利息，应收活期银行存款利息款项由基金管理人以自有资金先行垫付，供清算分配使用。

(2) 本基金最后运作日存出保证金71.71元，是由中国证券登记结算公司收取并保管的结算保证金。结算保证金每月调整一次，根据《结算保证金管理业务指南》，“中国证券登记结算有限责任公司于每月初第二个交易日，根据结算参与人对应结算备付金账户前6个月日均结算净额调整其结算互保金额度，但不低于初始结算保证金基数”，该款项已于2023年1月4日全部调回托管户，截至清算结束日2023年1月6日余额为0.00元。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产100,640.16元，全部为债券投资，本基金已于2022年12月29日完成全部交易性金融资产的变现。

5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为21.72元，该款项已于2023年1月5日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为7.17元，该款项已于2023年1月5日支

付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为0.02元，该款项已于2023年1月5日支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债30,500.00元，其中10,000.00元为预提2021年律师费，已于2023年1月11日支付；其中17,500.00元为清算期间审计费，已于2023年1月18日支付；其中3,000.00元为预提2022年4季度中债登账户维护费，已于2023年1月18日支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2022 年 12 月 29 日至 2023 年 1 月 6 日止清算期间
一、清算收益	-7.13
1、存款利息收入（注 1）	7.40
2、公允价值变动损益（注 2）	330.00
3、投资收益（注 2）	-344.84
4、其他收入（注 3）	0.31
二、清算费用	0.00
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	-7.13

注1：存款利息收入系计提的清算期间的银行存款利息。银行存款利息由托管银行于每季度3月、6月、9月、12月21日结算入账，或在账户注销时一次性结清。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付尚未收讫的利息。

注2：投资收益为清算期间持有的交易性金融资产产生的利息收入和处置产生的差价收入，同时将原计入该金融资产的公允价值变动转出至投资收益的金额。

注3：其他收入系投资者在最后运作日申请赎回所产生的基金赎回费收入。

5.5 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 2022 年 12 月 28 日基金净资产	76,599.89
加：自 2022 年 12 月 29 日至 2023 年 1 月 6 日止清算期间净收益（损失以“-”填列）	-7.13
减：清算期间确认的最后运作日净赎回金额（含费用）	271.68
二、清算结束日 2023 年 1 月 6 日基金净资产	76,321.08

资产处置及负债清偿后，于清算结束日2023年1月6日本基金剩余财产为人民币76,321.08元。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。

清算结束日次日 2023 年 1 月 7 日至清算款划出日前一日的银行存款、存出保证金产生的利息收入亦属份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，截至清算款划出日前一日的银行存款利息、存出保证金利息中仍未收到的部分将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

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，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、《基金合同》等规定及时进行分配。

§6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 1、《金鹰添荣纯债债券型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《金鹰添荣纯债债券型证券投资基金基金清算事宜之法律意见》

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人金鹰基金管理有限公司

客户服务电话：400-6135-888

金鹰添荣纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二三年三月十四日