

农银汇理永盛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: 二零二二年七月二十一日

清算报告公告日: 二零二二年八月六日

§1 重要提示

农银汇理永盛定期开放混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据中国证监会 2017 年 7 月 25 日《关于准予农银汇理永盛定期开放混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2017】1349 号）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《农银汇理永盛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 210,452,931.61 元，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(19)第 00097 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《农银汇理永盛定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 3 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 210,568,070.43 份基金份额，其中认购资金利息折合 115,138.82 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理永盛定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票）、债券（国债、金融债、公司债、企业债、可转债、可分离债、央票、中期票据、短期融资券（含超短期融资券））、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、定期存款、协议存款、同业存单、权证、股指期货等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。本基金股票、权证、股指期货等资产占基金资产的比例不高于 60%，债券、债券回购、资产支持证券、银行存款等资产占基金资产的比例不低于 40%。在开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%；在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；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：沪深 300 指数收益率*20%+中证全债指数收益率*80%。

根据《农银汇理永盛定期开放混合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 2022 年 4 月 14 日发布的《农银汇理永盛定期开放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》，本基金的最后运作日为 2022 年 4 月 14 日，并自 2022 年 4 月 15 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 2022 年 4 月 15 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	农银永盛定期开放混合
基金主代码	006534
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年3月12日
最后运作日(2022年4月14日) 基金份额总额	25,154,539.48份
投资目标	在严格控制风险的基础上，运用恒定比例投资组合保险（CPPI）策略，通过资产的动态配置和有效的组合管理，有效控制本金损失的风险，在本金安全的基础上力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将投资品种分为股票等资产和债券等资产两类，采用恒定比例投资组合保险（Constant Proportion Portfolio Insurance，以下简称“CPPI”）策略。本基金在封闭期内将严格遵守CPPI策略，实现对股票等资产和债券等资产的优化动态调整和资产配置，力争投资本金的稳定性。同时，本基金通过积极稳健的资产投资策略，竭力为基金资产获取稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*20%+中证全债指数收益率*80%。
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。

§3 基金运作情况概述

农银汇理永盛定期开放混合型证券投资基金根据中国证监会 2017 年 7 月 25 日《关于准予农银汇理永盛定期开放混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2017】1349 号）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《农银汇理永盛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 210,452,931.61 元，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙) 德师报(验)字(19)第 00097 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《农银汇理永盛定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 3 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 210,568,070.43 份基金份额，其中认购资金利息折合 115,138.82 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理永盛定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票）、债券（国债、金融债、公司债、企业债、可转债、可分离债、央票、中期票据、短期融资券（含超短期融资券））、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、定期存款、协议存款、同业存单、权证、股指期货等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。本基金股票、权证、股指期货等资产占基金资产的比例不高于 60%，债券、债券回购、资产支持证券、银行存款等资产占基金资产的比例不低于 40%。在开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%；在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；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：沪深 300 指数收益率*20%+中证全债指数收益率*80%。

根据《农银汇理永盛定期开放混合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 2022 年 4 月 14 日发布的《农银汇理永盛定期开放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》，本基金的最后运作日为 2022 年 4 月 14 日，并自 2022 年 4 月 15 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：农银汇理永盛定期开放混合型证券投资基金

报告期间：2022年4月15日(清算开始日)至2022年7月6日(清算结束日)

单位:人民币元

资产	本期末 2022年4月14日 (基金最后运作日)	2022年7月6日 (清算结束日)
资产：		
银行存款	22,672,986.08	31,364,978.59
结算备付金	387,924.05	-
存出保证金	11,167.35	6.24
交易性金融资产	2,059,943.56	-
其中：股票投资	-	-
债券投资	2,059,943.56	-
买入返售金融资产	6,200,000.00	-
应收证券清算款	6,178,258.80	-
资产总计：	37,510,279.84	31,364,984.83
负债和净资产		
负债：		
应付赎回款	6,052,917.74	-
应付管理人报酬	17,804.13	-
应付托管费	3,709.19	-
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6,768.26	-
应付税费	454.99	-
其他负债	53,000.00	-
负债合计	6,134,654.31	-
净资产：		
实收基金	25,154,539.48	25,154,539.48
未分配利润	6,221,086.05	6,210,445.35
净资产合计	31,375,625.53	31,364,984.83
负债和净资产总计：	37,510,279.84	31,364,984.83

注：

1. 截至2022年4月14日(基金最后运作日)，基金份额净值人民币1.2473元，基金份额总额25,154,539.48份。

4.2 清算损益表(已审计)

会计主体：农银汇理永盛定期开放混合型证券投资基金

报告期间：2022年4月15日(清算开始日)至2022年7月6日(清算结束日)

单位:人民币元

项目	2022年4月15日(清算开始日)至2022年7月6日(清算结束日)止期间
一、收入	26,165.36
1、利息收入	26,694.47
其中：存款利息收入	25,716.06
买入返售金融资产收入	978.41
2、投资收益(损失以“-”填列)	-14,440.67
其中：股票投资收益	-
债券投资收益	-14,440.67
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)	13,911.56
4、其他收入(损失以“-”填列)	-
二、费用	36,806.06
1、管理人报酬	-
2、基金托管费	-
3、销售服务费	-
4、交易费用	-
5、其他费用	36,806.06
三、利润总额	-10,640.70
减：所得税费用	-
四、净收益	-10,640.70

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【】出具了德师报(审)字(22)第 S00404 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4月15日进入清算期，自2022年4月15日至7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 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日活期存款为22,672,986.08元，含应计利息2,341.24元。应计活期存款利息于2022年6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387,924.05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2022年5月6日调整为308,520.92元，于2022年6月2日调整为1,525.91元，

应计利息于 2022 年 6 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 11,167.35 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存出保证金及应计利息，该款项于 2022 年 5 月 6 日调整为 10,779.27 元，于 2022 年 6 月 2 日调整为 10,841.41 元，于 2022 年 7 月 4 日调整为 6.24 元，应计利息预计将于 2022 年 9 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 2,059,943.56 元（含应计利息），为了保护基金份额持有人利益，截至 2022 年 4 月 15 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 2,059,569.45 元。

5.1.5 本基金最后运作日买入返售金融资产 6,200,000.00 元，该款项于 2022 年 4 月 15 日划入托管户。

5.1.6 本基金最后运作日应收证券清算款 6,178,258.80 元，该款项于 2022 年 4 月 15 日划入托管户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款 6,052,917.74 元，于 2022 年 4 月 15 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬 17,804.13 元，于 2022 年 5 月 9 日支付。

。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费 3,709.19 元，于 2022 年 5 月 9 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付交易费用 6,768.26 元，其中应付中债登债券结算服务费 1,350.00 元于 2022 年 4 月 18 号支付，应付外汇交易手续费 225.00 元于 2022 年 4 月 18 号支付，应付交易佣金 5,193.26 元于 2022 年 7 月 6 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日应付税费 454.99 元，于 2022 年 5 月 11 日支付。

5.2.6 本基金最后运作日其他负债 53,000.00 元。其中预提的审计费 31,000.00 元，于 2022 年 5 月 31 日支付预提 2021 年度审计费人民币 20,000.00 元，2022 年 7 月 6 日支付 2022 年清算审计费人民币 11,000.00 元；2022 年信息披露费 22,000.00 元，于 2022 年 6 月 24 日支付。

5.2.7 本基金最后运作日无应付证券清算款。

5.2.8 本基金最后运作日无应付利息。

5.3 清算期间（2022年4月15日截止至2022年7月6日）的清算损益情况

5.3.1 截止至2022年7月6日的利息收入金额26,694.47元，系计提的自2022年4月15日至2022年7月6日的活期存款利息收入、结算备付金利息收入、存出保证金利息收入和买入返售利息收入。

5.3.2 清算期间的债券的投资收益金额-14,440.67元，其中包括本基金最后运作日持有的债券资产变现所得-14,285.67元，卖出债券的交易费用155.00元，交易性债券利息收入0元。清算期间的债券公允价值变动损益金额13,911.56元，系本基金最后运作日债券投资估值增值结转额。

5.3.3 清算期间产生的总费用36,806.06元，其中包括清算律师费18,000.00元，中债账户销户时缴纳的账户维护费9,000.00元和上清所账户销户时缴纳的账户维护费9,600.00元，银行汇划费206.06元。

5.3.4 按照《农银汇理永盛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	31,375,625.53	2022-04-14
二、清算期间基金份额交易产生的基金净值变动数	0	
加:申购款	0	
减:赎回款	0	
三、加:清算期间净收益（净亏损用负号表示）	-10,640.70	
四、清算报告出具日基金净资产	31,364,984.83	2022-07-06

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（清算结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金产生的利息亦属份额持有人所有）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2022年7月6日止的剩余净资产为31,364,984.83元。

截至2022年7月6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活期存款余额共人民币31,360,400.74元，应计活期存款利息4,577.85元。待结息存出保证金利息为6.24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。

农银汇理永盛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:2022年7月21日

清算报告公告日:2022年8月6日