

金鹰添富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：交通银行股份有限公司
清算报告出具日：2019年10月15日
清算报告公告日：2019年10月26日

一、重要提示

金鹰添富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 2016 年 10 月 14 日《关于准予金鹰添富纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】2347 号）注册公开募集，自 2016 年 11 月 28 日起《金鹰添富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”）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”），基金托管人为交通银行股份有限公司（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》和《基金合同》的有关规定，“《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形的，则自动终止基金合同并进入基金财产的清算程序，无须召开基金份额持有人大会审议。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

截至 2019 年 9 月 18 日日终，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，已触发《基金合同》中终止基金合同情形的有关约定。根据基金合同约定，本基金基金合同自动终止并于 2019 年 9 月 19 日进入基金财产的清算程序，且无需召开基金份额持有人大会审议。

基金管理人、基金托管人、中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）和广东岭南律师事务所于 2019 年 9 月 19 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由中审众环会计师事务所（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。

二、基金概况

基金名称	金鹰添富纯债债券型证券投资基金
基金简称	金鹰添富纯债债券
基金主代码	003833
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 28 日

最后运作日 (2019-9-18) 基金份额总额	597,498.30 份
最后运作日 (2019-9-18) 基金份额净值	1.0225
投资目标	在严控风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>本基金充分考虑基金资产的安全性、收益性及流动性，在严格控制风险的前提下力争实现资产的稳定增值。在资产配置中，本基金以债券为主，通过密切关注债券市场变化，持续研究债券市场运行状况、研判市场风险，在确保资产稳定增值的基础上，通过积极主动的资产配置，力争实现超越业绩基准的投资收益。</p> <p>具体投资策略包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略及中小企业私募债投资策略。其中，债券投资策略包含类属配置策略、久期配置策略、收益率曲线策略、套利策略、相对价值投资策略、信用利率曲线策略。</p>
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	本基金是债券型基金，属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的基金品种，其预期风险及预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

三、基金运作情况

本基金经中国证监会 2016 年 10 月 14 日证监许可【2016】2347 号文注册募集，由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定自 2016 年 11 月 22 日起至 2016 年 11 月 24 日止向社会公开募集。本基金《基金合同》于 2016 年 11 月 28 日正式生效，《基金合同》生效日的基金份额（含利息结转的份额）总数为 200,020,453.62 份。自 2016 年 11 月 28 日至 2019 年 9 月 18 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》和《基金合同》的有关规定，“《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形的，则自动终止基金合同并进入基金财产的清算程序，无须召开基金份额持有人大会

审议。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”截至 2019 年 9 月 18 日日终，本基金基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额，出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，已触发《基金合同》中终止基金合同情形的有关约定。根据基金合同约定，本基金基金合同自动终止并于 2019 年 9 月 19 日进入基金财产的清算程序，且无需召开基金份额持有人大会审议。

基金管理人于 2019 年 9 月 19 日发布了《金鹰基金管理有限公司关于金鹰添富纯债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》，本基金自 2019 年 9 月 19 日起进入基金财产的清算程序。

四、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：金鹰添富纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 9 月 18 日

单位：人民币元

	最后运作日 2019 年 9 月 18 日
资产：	
银行存款	194,101.37
存出保证金	42.98
交易性金融资产	576,637.20
其中：债券投资	576,637.20
应收利息	17,880.87
应收申购款	99.92
资产总计	788,762.34
负债：	
应付管理人报酬	85.13
应付托管费	28.39
其它负债	177,730.10
负债合计	177,843.62
所有者权益：	
实收基金	597,498.30
未分配利润	13,420.42
所有者权益合计	610,918.72
负债和所有者权益总计	788,762.34

注：① 本基金最后运作日 2019 年 9 月 18 日，基金份额净值为 1.0225 元，基金份额为 597,498.30 份，资产净值为 610,918.72 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。

五、清算情况

自 2019 年 9 月 19 日至 2019 年 10 月 15 日止为清算期间，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。

1、清算费用

按照《金鹰添富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剩余财产中支付。

考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，根据金鹰基金管理有限公司《关于金鹰添富纯债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》，本基金清算期间的审计费、律师费将由基金管理人承担。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款 194,101.37 元，是存储于基金托管人交通银行股份有限公司的活期银行存款。

(2) 本基金最后运作日存出保证金 42.98 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”。此笔款项已于 2019 年 10 月 9 日返还托管账户。本基金因资产变现新产生的结算保证金或清算备付金，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返还的结算保证金或清算备付金。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产 576,637.20 元，均为交易类债券投资资产，本基金已于 2019 年 10 月 9 日完成相关资产的变现。

(4) 本基金最后运作日应收利息 17,880.87 元,其中包括活期银行存款利息 9,221.05 元,已于 2019 年 9 月 23 日由托管银行结算入账; 结算保证金利息 5.89 元,已于 2019 年 9 月 21 日由托管银行结算入账; 债券利息 8,653.93 元,已于 2019 年 10 月 9 日卖出债券时结算入账。

(5) 本基金最后运作日应收申购款 99.92 元,为 2019 年 9 月 18 日确认的申购款,此笔款项已于 2019 年 9 月 19 日结算入账。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为 85.13 元,该款项已于 2019 年 10 月 9 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为 28.39 元,该款项已于 2019 年 10 月 9 日支付。

(3) 本基金最后运作日其他负债 177,730.10 元,该款项包含应付上交所证券清算款 91,359.58 元,该款项已于 2019 年 9 月 19 日支付; 预提 2019 年中债账户维护费 9,000.00 元,该款项已于 2019 年 9 月 26 日支付 4,500.00 元,剩余金额于同日冲回基金资产; 预提 2019 年上清所账户维护费 9,600.00 元,该款项已于 2019 年 9 月 30 日支付 4,800.00 元,剩余金额于同日冲回基金资产。预提 2019 年上海证券报信息披露费 40,000.00 元,其中截至 2019 年 9 月 18 日应预提 5,901.64 元,该款项将于收到上海证券报社付费发票后进行支付,剩余金额 34,098.36 元已于 2019 年 9 月 19 日冲回基金资产; 预提 2019 年审计费 27,770.52 元,因审计费不再从基金资产支付,预提审计费已于 2019 年 9 月 19 日冲回基金资产。

4、清算期剩余资产分配情况

单位: 人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2019 年 9 月 18 日基金净资产	610,918.72
加: 清算期间 (2019-9-19 至 2019-10-15) 收入	
利息收入-银行存款利息收入 (注①)	125.98
利息收入-清算备金利息收入 (注①)	0.42
利息收入-结算保证金利息收入 (注①)	0.16
利息收入-债券利息收入 (注②)	847.80
债券投资收益 (注③)	-159.70
公允价值变动损益 (注④)	-37.90
其他收入 (注⑤)	71,171.98

减：清算期间（2019-9-19 至 2019-10-15）费用	
交易费用（注⑥）	1.41
清算费用（注⑦）	0.00
其他费用（注⑧）	40.00
减：基金净赎回金额（于 2019 年 9 月 19 日确认的投资者申购、赎回申请）	9,989.44
二、2019 年 10 月 15 日基金净资产	672,836.61

注：① 利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2019 年 9 月 19 日至 2019 年 10 月 15 日止清算期间的银行存款利息、备付金利息和结算保证金利息。活期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（节假日顺延）结算入账，或在账户注销时一次性结清；最低备付金利息及结算保证金利息由中国证券登记结算有限责任公司于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日（节假日顺延）结算入账。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；

② 利息收入-债券利息收入系清算期间所持有债券投资的利息收入；

③ 债券投资收益系清算期间卖出所持债券获得的差价收入；

④ 公允价值变动损益系所持债券清算期间的公允价值变动损益；

⑤ 其他收入系清算期间冲回的预提信息披露费、审计费用、账户维护费，以及清算期间的赎回费收入；

⑥ 交易费用为清算期间基金资产变现产生的交易费用；

⑦ 清算费用为基金清算相关的审计费和律师费，该费用由基金管理人支付；

⑧ 其他费用系自 2019 年 9 月 19 日至 2019 年 10 月 15 日止清算期间托管账户扣缴的银行划汇费。

资产处置及负债清偿后，于 2019 年 10 月 15 日本基金剩余财产为人民币 672,836.61 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。

2019 年 10 月 16 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息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，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。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。

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，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 《金鹰添富纯债债券型证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《金鹰添富纯债债券型证券投资基金清算事宜之法律意见》

2、存放地点

基金管理人的办公场所

3、查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅

金鹰添富纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组
2019年10月15日