

金鹰添享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：浙商银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二〇年十二月三十日

清算报告公告日：二〇二一年一月十四日

§1 重要提示

金鹰添享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 31 日《关于准予金鹰添享纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】2480 号）注册公开募集，自 2017 年 2 月 28 日起《金鹰添享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”），基金托管人为浙商银行股份有限公司（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》的有关约定，基金管理人经与基金托管人协商一致，召集了本基金基金份额持有人大会，审议《关于终止金鹰添享纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，议案于 2020 年 12 月 21 日表决通过，自该日起本次基金份额持有人大会决议生效，详见基金管理人于 2020 年 12 月 23 日在《中国证券报》和基金管理人官网发布的《金鹰添享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》。

本基金最后运作日为 2020 年 12 月 23 日。本基金从 2020 年 12 月 24 日起进入清算期，清算期间为自 2020 年 12 月 24 日至 2020 年 12 月 28 日止。由基金管理人、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组成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。

§2 基金概况

基金名称	金鹰添享纯债债券型证券投资基金
基金简称	金鹰添享纯债债券
基金主代码	003852
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 2 月 28 日

最后运作日(2020-12-23) 基金份额总额	682,378.26 份
最后运作日(2020-12-23) 基金份额净值	0.8959
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	<p>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。</p> <p>(一) 资产配置策略</p> <p>本基金在综合判断宏观经济形势以及微观市场的基础上, 分析不同类别资产的收益率水平、流动性特征和风险水平特征, 确定大类金融资产配置和债券类属配置, 同时, 根据市场的变化, 动态调整大类资产和债券资产的投资比例, 以规避市场风险, 提高投资收益。</p> <p>(二) 债券投资策略</p> <p>债券投资策略主要包含类属配置策略、久期配置策略、收益率曲线策略、杠杆策略、相对价值投资策略、信用利差曲线策略。</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	浙商银行股份有限公司

§3 基金运作情况

本基金经中国证券监督管理委员会《关于准予金鹰添享纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】2480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2月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为200,006,127.16份。自2017年2月28日至2020年12月23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》的有关约定，基金管理人经与基金托管人协商一致，召集了本次基金份额持有人大会，审议《关于终止金鹰添享纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，议案于2020年12月21日表决通过，自该日起本次基金份额持有人大会决议生效，详见基金管理人于2020年12月23日在《中国证券报》和基金管理人官网发布的《金鹰添享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》。本基金最后运作日为2020年12月23日，自2020年12月24日起，本基金进入基金财产清算程序。

§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：金鹰添享纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2020年12月23日

单位：人民币元

	最后运作日 2020年12月23日
资产：	
银行存款	3,545.56
结算备付金	5,203.37
存出保证金	124.76

交易性金融资产	514,139.70
其中：债券投资	514,139.70
买入返售金融资产	100,000.00
应收证券清算款	8.07
应收利息	7,901.66
应收申购款	99.92
资产总计	631,023.04
负债：	
应付管理人报酬	114.60
应付托管费	38.22
其他负债	19,561.12
负债合计	19,713.94
所有者权益：	
实收基金	682,378.26
未分配利润	-71,069.16
所有者权益合计	611,309.10
负债和所有者权益总计	631,023.04

注：1、报告截止日2020年12月23日（本基金最后运作日），基金份额净值为0.8959元，基金份额为682,378.26份，资产净值为611,309.10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2020年12月24日至2020年12月28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。具体清算情况如下：

5.1 清算费用

按照《金鹰添享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。

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《金鹰基金管理有限公司关于以通讯方式召开金鹰添享纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，本基金清算期间律师费将由基金管理人承担。

5.2 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款3,545.56元，是存储于基金托管人浙商银行股份有限公司的活期银行存款。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为5,203.37元，该款项由中国证券登记结算有限公司收取并保管，截至清算结束日2020年12月28日余额为5,203.37元，该款项将由基金管理人以自有资金先行垫付，供清盘分配使用。

(3) 本基金最后运作日存出保证金124.76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”，截至清算结束日2020年12月28日余额为124.76元，该款项将由基金管理人以自有资金先行垫付，供清盘分配使用。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产514,139.70元，均为交易类债券投资资产，本基金已于2020年12月25日完成全部交易性金融资产的变现。

(4) 本基金最后运作日买入返售金融资产100,000.00元，均为交易所质押式回购，该笔质押式回购已于2020年12月24日到期。

(5) 本基金最后运作日应收利息7,901.66元，其中应收活期银行存款利息0.12元，款项将由基金管理人以自有资金先行垫付，供清盘分配使用；应收结算备付金利息0.48元，款项将由基金管理人以自有资金先行垫付，供清盘分配使用；应收债券利息7,901.06元，已于2020年12月24日及2020年12月25日卖出债券时结算入账。

(5) 本基金最后运作日应收证券清算款8.07元，该款项为中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券清算款，已于2020年12月24日划至基金托管户。

(6) 本基金最后运作日应收申购款99.92元，为2020年12月23日确认的申购

款，此笔款项已于2020年12月24日结算入账。

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114.60元，该款项已于2020年12月28日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为38.22元，该款项已于2020年12月28日支付。

(3) 本基金最后运作日其他负债19,561.12元，该款项为预提2020年审计费，扣除清算期间审计费10,000.00元，差额9,561.12元已于2020年12月28日冲回基金资产。清算期间审计费10,000.00元将于收到会计师事务所付费发票后进行支付。

5.4 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 2020 年 12 月 23 日基金净资产	611,309.10
加：清算期间（2020-12-24 至 2020-12-28）收入	
利息收入-银行存款利息收入（注 1）	48.76
利息收入-结算备金利息收入（注 1）	1.44
利息收入-买入返售金融资产利息收入（注 2）	7.26
利息收入-债券利息收入（注 3）	47.43
债券投资收益（注 4）	-8,028.98
公允价值变动损益（注 5）	8,383.20
其他收入（注 6）	9,564.86
减：清算期间（2020-12-24 至 2020-12-28）费用	
交易费用（注 7）	3.81
减：基金净赎回金额（于 2019 年 12 月 23 日确认的投资者申购、赎回申请）	17,345.36
二、2020 年 12 月 28 日基金净资产	603,983.90

注：（1）利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2020年12月24日至2020年12月28日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。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；结算备付金利息及存出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-买入返售金融资产利息收入系买入返售金融资产投资的利息收入；
- (3) 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；
- (4) 债券投资收益系清算期间卖出所持债券获得的差价收入；
- (5) 公允价值变动损益系清算期间所持债券的公允价值变动损益；
- (6) 其他收入系清算期间冲回的预提审计费，以及清算期间赎回费收入；
- (7) 交易费用为清算期间基金资产变现产生的交易费用；

资产处置及负债清偿后，于清算结束日2020年12月28日本基金剩余财产为人民币603,983.90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2020年12月29日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金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，截至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金的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。

§6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 1、《金鹰添享纯债债券型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《金鹰添享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

金鹰添享纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二一年一月十四日