

融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）

清算报告

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年一月一十五日

报告公告日期：二〇一八年三月八日

一、重要提示

融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）由融通中证大农业指数分级证券投资基金转型而来。《关于融通中证大农业指数分级证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》经融通中证大农业指数分级证券投资基金份额持有人大会决议通过，内容包括融通中证大农业指数分级证券投资基金变更基金名称，调整基金份额结构、降低费用标准等事项。持有人大会决议自通过之日起生效并于 2016 年 7 月 29 日正式实施基金转型，自基金转型实施之日起，《融通中证大农业指数分级证券投资基金基金合同》失效且《融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）同时生效，融通中证大农业指数分级证券投资基金正式变更为融通中证大农业指数证券投资基金（LOF），基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

因市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，本基金管理人根据《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《融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，提议终止《融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金合同》。本基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，会议已于 2017 年 12 月 28 日表决通过了《关于终止融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》，决定终止《融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金合同》。基金份额持有人大会的表决结果及决议生效的公告详见 2017 年 12 月 29 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站上的《关于融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。根据基金合同及相关公告约定，本基金管理人已向深圳证券交易所申请终止本基金的上市交易，并获得深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2018]2 号）的同意，本基金管理人于 2018 年 1 月 3 日发布《关于融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）终止上市及终止办理申购赎回等业务的公告》，本基金终止上市日为 2018 年 1 月 8 日。本基金于 2018 年 1 月 8 日终止上市并进入清算期，由基金管理人融通基金管理有限公司、基金托管人中国农业银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2018 年 1 月 8 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，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

| | |
|-------------------------------|---|
| 基金名称 | 融通中证大农业指数证券投资基金（LOF） |
| 基金简称 | 通中证大农业指数基金（LOF） |
| 基金主代码 | 161630 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式（LOF） |
| 基金合同生效日 | 2016年7月29日 |
| 基金管理人 | 融通基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 最后运作日 （2018-1-7） 基金份额总额 | 14,126,790.01 份 |
| 投资目标 | 本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证大农业指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。 |
| 投资策略 | 本基金采用完全复制法进行投资，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对投资组合进行相应调整。 |
| 业绩比较基准 | 95%×中证大农业指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）。 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。 |

三、基金运作情况

本基金基金合同自 2016 年 7 月 29 日起正式生效。自 2016 年 7 月 29 至 2018 年 1 月 7 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

因市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，本基金管理人根据《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《融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，提议终止《融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金合同》，本基金基金份额持有人大会已于 2017 年 12 月 19 日起至 2017 年 12 月 27 日 17:00 期间以通讯方式召开，此次持有人大会的计票于 2017 年 12 月 28 日进行，会议表决通过了《关于终止融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》，并于 2017 年 12 月 29 日对外公告。根据基金合同及相关公告约定，本基金管理人已向深圳证券交易所申请终止本基金的上市交易，并获得深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2018]2 号）的同意，本基金管理人于 2018 年 1 月 3 日发布

《关于融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）终止上市及终止办理申购赎回等业务的公告》，本基金终止上市日为 2018 年 1 月 8 日，并自该日起开始进入清算程序。

四、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2018 年 1 月 7 日

单位：人民币元

| 资产 | 2018 年 1 月 7 日(基金最后运作日) |
|-------------------|-------------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 12,452,358.10 |
| 存出保证金 | 6,903.44 |
| 交易性金融资产 | 2,140,017.64 |
| 其中：股票投资 | 2,140,017.64 |
| 应收利息 | 4,936.75 |
| 资产总计 | 14,604,215.93 |
| 负债和所有者权益 | |
| 负债： | |
| 应付赎回款 | 1,158,650.64 |
| 应付管理人报酬 | 2,161.15 |
| 应付托管费 | 540.29 |
| 应付交易费用 | 14,539.27 |
| 其他负债 | 100,597.04 |
| 负债合计 | 1,276,488.39 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 13,991,576.95 |
| 未分配利润 | -663,849.41 |
| 所有者权益合计 | 13,327,727.54 |
| 负债和所有者权益总计 | 14,604,215.93 |

注：报告截止日 2018 年 1 月 7 日（基金最后运作日），基金份额净值 0.943 元，基金份额总额 14,126,790.01 份。

五、清算情况

自 2018 年 1 月 8 日至 2018 年 1 月 14 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金合同》第二十四部分“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。

2、资产处置情况

截至本次清算期结束日（2018年1月14日），部分资产尚未收回或者完成变现，为了提高清算效率，及时向基金份额持有人分配剩余财产，基金管理人以自有资金对该部分资产进行垫付。各项资产清算情况如下：

（1）本基金最后运作日的银行存款余额为人民币 12,452,358.10 元，该部分款项由基金托管人负责保管；

（2）本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 6,903.44 元，该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管。待实际划付清算款时，该笔款项由基金管理人融通基金管理有限公司以自有资金先行垫付，供清盘分配使用，待回款后再返还给基金管理人；

（3）本基金最后运作日应收利息人民币 4,936.75 元，该款项待实际划付清算款时由基金管理人融通基金管理有限公司以自有资金先行垫付，供清盘分配使用，待结息日回款后再返还给基金管理人。

（4）本基金最后运作日持有的股票资产全部为停牌股票，股票市值为人民币 2,140,017.64 元，该金额为各只股票的最后运作日估值金额之和。

本基金最后运作日（2018年1月7日）持有的全部停牌股票明细如下：

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 股票数量 (股) | 估值价格 (人民币元) | 最后运作日估值金 额 (人民币元) |
|----|--------|------|-------------|----------------|----------------------|
| 1 | 002470 | 金正大 | 51,508 | 8.84 | 455,330.72 |
| 2 | 000930 | 中粮生化 | 31,693 | 13.34 | 422,784.62 |
| 3 | 000979 | 中弘股份 | 170,361 | 2.17 | 369,683.37 |
| 4 | 000592 | 平潭发展 | 51,600 | 5.75 | 296,700.00 |
| 5 | 300159 | 新研股份 | 24,880 | 10.40 | 258,752.00 |
| 6 | 600226 | 瀚叶股份 | 40,223 | 5.93 | 238,522.39 |
| 7 | 002004 | 华邦健康 | 14,598 | 6.73 | 98,244.54 |
| 合计 | | | | | 2,140,017.64 |

基金管理人以自有资金垫付截至本次清算期结束日仍持有的停牌股票资产，该款项由

管理人垫付至托管账户。待停牌股票变现后，若本基金所持停牌股票整体变现金额高于基金管理人为本基金停牌股票垫付的金额，则将差额按基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人；若本基金所持停牌股票整体变现金额小于基金管理人为本基金停牌股票垫付的金额，则差额由基金管理人承担。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 2,161.15 元，该款项已于 2018 年 1 月 8 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 540.29 元，该款项已于 2018 年 1 月 8 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 14,539.27 元，该款项已于 2018 年 1 月 8 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 1,158,650.64 元，该款项已于 2018 年 1 月 9 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 100,597.04 元，包括应付指数使用费、应付上市费、应付赎回费和预提审计费等。

本基金最后运作日应付指数使用费为人民币 53,888.89 元，该款项已于 2018 年 1 月 12 日支付。

本基金最后运作日应付上市费为人民币 5,000.00 元，该款项将于 2018 年 1 月 8 日后按照深圳证券交易所的规定支付；

本基金最后运作日应付赎回费为人民币 1,708.15 元，该款项已于 2018 年 1 月 9 日全部支付；

本基金最后运作日预提审计费为预提的 2017 年审计费，金额为人民币 40,000.00 元，该款项已于 2018 年 1 月 12 日支付。

4、清算期间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 2018 年 1 月 7 日基金净资产 | 13,327,727.54 |
| 加：清算期间（2018-1-8 至 2018-1-14）收入 | 1,563.26 |
| 股票变现收入 | - |

| | |
|------------------------------|---------------|
| 利息收入-银行存款利息收入（注1） | 1,561.09 |
| 利息收入-存出保证金利息收入（注2） | 2.17 |
| 减：清算期间（2018-1-8至2018-1-14）费用 | 302,327.34 |
| 应付赎回款和赎回费 | 246,327.34 |
| 持有人大会律师费 | 35,000.00 |
| 银行汇划费 | 1,000.00 |
| 清算期审计费 | 20,000.00 |
| 二、2018年1月14日基金净资产 | 13,026,963.46 |

注：（1）利息收入暂以当前适用的利率预估计提的自2018年1月8日至2018年1月14日止（假定清算款划付日期为2018年1月15日）清算期间的银行存款利息，若清算款实际划付日期变更，该金额也将相应调整。

（2）利息收入暂以当前适用的利率预估计提的自2018年1月8日至2018年1月14日止（假定清算款划付日期为2018年1月15日）清算期间的存出保证金利息，若清算款实际划付日期变更，该金额也将相应调整。

（3）本基金最后运作日为2018年1月7日，2018年1月8日开始进入清算期，以上清算期资产状况包含2018年1月8日至2018年1月14日期间的利息收入。

（4）应付赎回款和赎回费为基金份额持有人于2018年1月5日提出的赎回申请产生的应付赎回款和应付赎回费，该笔款项已于2018年1月10日支付。

（5）律师费为召开持有人大会产生的律师费，该笔款项已于1月12日支付。

资产处置及负债清偿后，于2018年1月14日本基金剩余财产为人民币13,026,963.46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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2018年1月8日至清算款实际划出日前一日的银行存款、存出保证金等产生的利息属基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人融通基金管理有限公司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。待结息日回款后再返还基金管理人。

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，报中国证监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) 《融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）2017年1月1日至2017年12月31日止期间的审计报告》及《融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）2018年1月1日至2018年1月7(基金最后运作日)止期间的审计报告》

(2) 关于《融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）清算报告》的法律意见

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内至基金管理人的办公场所免费查阅。

融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金财产清算小组

2018年1月15日