

融通增丰债券型证券投资基金

清算报告

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十日

报告公告日期：二〇一八年四月十六日

一、重要提示

融通增丰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(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1123号《关于准予融通增丰债券型证券投资基金注册的批复》准予募集注册,由融通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《融通增丰债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集,基金合同生效日为2016年7月19日,基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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《融通增丰债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,提议终止《融通增丰债券型证券投资基金基金合同》。本基金基金份额持有人大会以通讯方式召开,会议已于2018年2月27日表决通过了《关于终止融通增丰债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,决定终止《融通增丰债券型证券投资基金基金合同》。基金份额持有人大会的表决结果及决议生效的公告详见2018年2月28日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》和基金管理人网站上的《关于融通增丰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的公告》。

本基金于2018年3月1日起进入清算期,由基金管理人融通基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、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3月1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	融通增丰债券型证券投资基金
基金简称	融通增丰债券
基金主代码	002922
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年7月19日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
最后运作日 (2018-2-28)	200,021,579.99份
基金份额总额	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的

	投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的具体投资策略包括资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略、权证投资策略以及国债期货投资策略等部分。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

三、基金运作情况

本基金基金合同自 2016 年 7 月 19 日起正式生效。自 2016 年 7 月 19 日至 2018 年 2 月 28 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《融通增丰债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，提议终止《融通增丰债券型证券投资基金基金合同》，本基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，计票于 2018 年 2 月 27 日进行，会议表决通过了《关于终止融通增丰债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，并于 2018 年 2 月 28 日对外公告。本次基金份额持有人大会决议生效后，根据基金份额持有人大会通过的议案及方案说明，本基金从 2018 年 3 月 1 日起进入清算程序。

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：融通增丰债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 2 月 28 日

单位：人民币元

资产	2018 年 2 月 28 日(基金最后运作日)
资产：	
银行存款	6,377,680.15
结算备付金	495,531.20
存出保证金	2,071.12
交易性金融资产	201,003,500.00
其中：债券投资	201,003,500.00
应收利息	3,389,643.71
资产总计	211,268,426.18
负债和所有者权益	
负债：	

应付赎回款	10.35
应付赎回费	0.01
应付管理人报酬	64,605.80
应付托管费	16,151.48
应付交易费用	742.30
应交税费	21,284.35
其他负债	99,000.00
负债合计	201,794.29
所有者权益：	
实收基金	200,021,579.99
未分配利润	11,045,051.90
所有者权益合计	211,066,631.89
负债和所有者权益总计	211,268,426.18

注：报告截止日 2018 年 2 月 28 日（基金最后运作日），基金份额净值 1.055 元，基金份额总额 200,021,579.99 份。

五、清算情况

自 2018 年 3 月 1 日至 2018 年 3 月 20 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《融通增丰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。

2、资产处置情况

截至本基金最后运作日（2018 年 2 月 28 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 6,377,680.15 元，该部分款项由基金托管人负责保管；

（2）本基金最后运作日的结算备付金余额为人民币 495,531.20 元，该部分款项由基金托管人负责保管；

（3）本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 2,071.12 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；

(4) 本基金最后运作日应收存款及备付金保证金利息 10,583.90 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。

(5) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为债券投资，债券市值为人民币 201,003,500.00 元，应收利息 3,379,059.81 元，具体明细如下：

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	估值价格 (人民币元)	最后运作日估值金额 (人民币元)
1	011760073	17 南山集 SCP004	200,000	100.88	20,176,000.00
2	011761069	17 鲁晨鸣 SCP008	200,000	100.30	20,060,000.00
3	041754039	17 陕煤化 CP002	200,000	100.19	20,038,000.00
4	101763001	17 晋煤 MTN001	200,000	100.06	20,012,000.00
5	112281	15 中洲债	200,000	99.79	19,958,000.00
6	101752022	17 尧矿 MTN004	200,000	99.21	19,842,000.00
7	136176	16 绿地 01	200,000	97.91	19,582,000.00
8	122494	15 华夏 05	200,000	97.65	19,530,000.00
9	122803	PR 滁建投	190,000	93.05	17,679,500.00
10	124126	PR 柳城投	200,000	70.66	14,132,000.00
11	150212	15 国开 12	100,000	99.94	9,994,000.00
合计					201,003,500.00

上述债券已于清算期内变现完成，实际清算金额 204,763,880.54 元，已划入本基金托管账户。

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 64,605.80 元，该款项已于 2018 年 3 月 2 日支付；

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 16,151.48 元，该款项已于 2018 年 3 月 2 日支付；

(3) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 742.30 元，该款项待实际收缴时支付；

(4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 10.35 元，该款项已于 2018 年 3 月 2 日支

付；

(5) 本基金最后运作日应付赎回费为人民币 0.01 元，该款项已于 2018 年 3 月 2 日支

付；

(6) 本基金最后运作日应交税费为人民币 21,284.35 元，该款项已于 2018 年 3 月 9 日支付；

(7) 本基金最后运作日其他负债为人民币 99,000.00 元：

其中应付信息披露费人民币 30,000.00 元，该款项于 2018 年 3 月 12 日全部支付；

应付审计费人民币 25,000.00 元，该款项已于 2018 年 3 月 12 日支付；

应付律师费人民币 35,000.00 元，该款项已于 2018 年 3 月 12 日支付；

应付账户维护费人民币 9,000.00 元，该款项待实际收缴时支付。

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 2 月 28 日基金净资产	211,066,631.89
加：清算期间（2018-3-1 至 2018-3-20）收入	
债券投资收益	-449,192.13
利息收入-银行存款利息收入（注 1）	60,082.72
利息收入-存出保证金利息收入（注 1）	2.00
利息收入-清算备付金利息收入（注 1）	22.30
利息收入-债券利息收入（注 2）	143,663.99
公允价值变动损益	687,205.55
减：清算期间（2018-3-1 至 2018-3-20）费用	
银行汇划费（注 3）	1,000.00
交易费用	3,484.18
银行间市场费用（注 4）	1,900.00
税金及附加（注 5）	4,528.36
二、2018 年 3 月 20 日基金净资产	211,497,503.78

注：（1）利息收入暂以当前适用利率预估计提自 2018 年 3 月 1 日至 2018 年 3 月 20 日止（假定清算款划付日期为 2018 年 3 月 21 日）清算期间的银行存款利息、存出保证金、清

算备付金利息，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-债券利息收入为 2018 年 3 月 1 日至债券卖出前一日的所有债券利息收入；

(3) 银行汇划费为清算期间的银行汇划费用，由本基金份额持有人承担，从基金财产中支付。该金额为预估费用，该费用若超出银行实际收取金额，多余部分待清算时一并划付基金份额持有人；

(4) 银行间市场费用为清算期间的银行间市场账户维护费用及查询服务费用，由本基金份额持有人承担，从基金财产中支付。该金额为预估费用，该费用若超出实际收取金额，多余部分待清算时一并划付基金份额持有人。

(5) 税金及附加为清算期间产生的增值税税金及附加税。

资产处置及负债清偿后，于 2018 年 3 月 20 日（假定清算款划付日期为 2018 年 3 月 21 日）本基金剩余财产为人民币 211,497,503.78 元（若清算款实际划付日期变更，该金额也将相应调整），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 3 月 1 日至清算款实际划付日前一日的银行存款、存出保证金、清算备付金等产生的利息属份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，清算款实际划付日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该笔款项，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，并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)《融通增丰债券型证券投资基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日止期间的财务报表及审计报告》及《融通增丰债券型证券投资基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 28 日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告

(2) 关于《融通增丰债券型证券投资基金清算报告》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。

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

2018年3月20日