

海富通富源债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日期：二〇一八年四月十七日

清算报告公告日期：二〇一八年六月二十一日

§1 重要提示

海富通富源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]1558号《关于准予海富通富源债券型证券投资基金注册的批复》注册募集。基金管理人为海富通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”),基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。本基金为契约型、开放式证券投资基金。《海富通富源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》”)于2017年3月17日正式生效。截至2018年1月4日,本基金已经连续60个工作日基金资产净值低于5000万元。

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》、《基金合同》的有关规定,鉴于本基金出现了基金合同终止事由,为维护基金份额持有人利益,基金管理人与基金托管人协商一致后,决定终止本基金基金合同并依法履行基金财产清算程序,此事项不需召开基金份额持有人大会。基金管理人已就该事项于2018年3月13日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站刊登了《关于海富通富源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》。本基金的最后运作日定为2018年3月19日,并于2018年3月20日进入清盘期。

基金管理人、基金托管人、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2月22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)对本基金进行清算审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

§2 基金产品概况

基金名称	海富通富源债券型证券投资基金
基金简称	海富通富源债券

基金主代码	519230
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月17日
基金最后运作日(2018年3月19日)基金份额总额	2,345,928.19
投资目标	本基金以债券等固定收益类产品为主要投资对象,在严格控制风险的基础上,通过积极主动的管理,力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金的投资策略包括资产配置策略、债券组合投资策略、信用类债券投资策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券投资策略、杠杆投资策略、可转换债券投资策略、国债期货投资策略、股票投资策略和权证投资策略。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险及预期收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,属于较低风险水平的投资品种。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可[2016]1558号《关于准予海富通富源债券型证券投资基金注册的批复》注册募集,为契约型、开放式证券投资基金,基金简称为海富通富源债券(基金代码:519230)。《海富通富源债券型证券投资基金基金合同》于2017年3月17日正式生效,共募集338,875,516.91份基金份额。截至2018年3月19日,本基金按基金合同正常运作。

依据《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,本基金已出现连续60个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元触发基金合同终止情形,此事项不需召开基金份额持有人大会。为维护基金份额持有人利益,根据基金合同约定,基金管理人

与基金托管人协商一致后，决定终止本基金基金合同。本基金最后运作日为2018年3月19日，清算期间为2018年3月20日至2018年4月17日。

§4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：海富通富源债券型证券投资基金

报告截止日：2018年3月19日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年3月19日 (基金最后运作日)
资产：	
银行存款	50,176.48
存出保证金	1,850.47
债券投资	2,136,393.40
证券清算款	515,079.48
应收利息	26,097.50
资产总计	2,729,597.33
负债和所有者权益	本期末 2018年3月19日 (基金最后运作日)
负债：	
应付赎回款	110,791.16
应付管理人报酬	1,122.16
应付托管费	320.59
其他负债	182,000.00
负债合计	294,233.91
所有者权益：	

实收基金	2,345,928.19
未分配利润	89,435.23
所有者权益合计	2,435,363.42
负债和所有者权益总计	2,729,597.33

注：报告截止日 2018 年 3 月 19 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.0381 元，基金份额总额 2,345,928.19 份。

4.2 利润表

会计主体：海富通富源债券型证券投资基金

报告期间：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 19 日(基金最后运作日)

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 19 日(基金最后运作日)
一、收入	65,991.42
利息收入	41,638.80
其中：存款利息收入	619.28
债券利息收入	41,019.52
买入返售金融资产收入	-
投资收益(损失以“-”填列)	-3,532.93
其中：股票投资收益	-
债券投资收益	-3,532.93
衍生工具收益	-
股利收益	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	25,780.23
其他收入(损失以“-”号填列)	2,105.32
减：二、费用	78,548.68
管理人报酬	5,373.08
托管费	1,535.17
交易费用	2.15
利息支出	263.28
其中：卖出回购金融资产支出	263.28
其他费用	71,375.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-12,557.26
减：所得税费用	-

四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-12,557.26
--------------------------	------------

注：本财务报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师薛竞、都晓燕签字出具了普华永道中天特审字(2018)第1925号标准无保留意见的审计报告。

§5 基金财产分配

本基金自 2018 年 3 月 20 日起进入清算程序，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 本基金最后运作日存出保证金金额 1,850.47 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算保证金。中国证券登记结算有限责任公司每月初第 2 个工作日对存出保证金进行调整，本基金已于 2018 年 4 月 3 日收回存出保证金 1,850.47 元。

5.1.2 本基金最后运作日交易型金融资产市值为 2,136,393.40 元，为非停牌债券资产。该资产已于 2018 年 3 月 20 日卖出，变现净收入（含债券利息收入）755.28 元归基金份额持有人所有。

5.1.3 本基金最后运作日应收利息为 26,097.50 元。其中应收活期银行存款利息为 531.16 元，应收备付金利息为 47.62 元，应收保证金利息金额为 7.04 元。本基金已于 2018 年 3 月 21 日收回上述利息。应收债券利息金额为 25,511.68 元，已于卖出债券时收回。

5.1.4 本基金最后运作日应收证券清算款 515,079.48 元，已于 2018 年 3 月 20 日划入托管账户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款 110,791.16 元，该款项分别于 2018 年 3 月 20 日、2018 年 3 月 21 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬 1,122.16 元，该款项已于 2018 年 4 月 10 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费 320.59 元，该款项已于 2018 年 4 月 10 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日其他负债 182,000.00 元，其中包括：

5.2.4.1 应付债券账户维护费 12,000.00 元，收到付费通知后，已于 2018 年 3 月 21 日和 2018 年 3 月 28 日分别支付 4,500.00 元，共支付 9,000.00 元。债券账户于 2018 年 3 月全部完成销户，故剩余 4 月的 3,000.00 元账户维护费已于 2018 年 3 月 28 日冲销。

5.2.4.2 应付审计费 50,000.00 元，待收到会计师事务所审计费发票后支付。

5.2.4.3 应付信息披露费 120,000.00 元，已于 2018 年 3 月 23 日支付 30,000.00 元，剩余 90,000.00 元待收到报社信息披露费发票后支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自2018年3月20日至 2018年4月17日（清算期截止 日）止
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	1,736.60
2、债券变现损益（注2）	419.60
清算收入小计	2,156.20
二、清算费用	
1、银行手续费	39.00
2、债券账户维护费（注3）	-3,000.00
3、交易费用（注4）	2.17
清算费用小计	-2,958.83
二、清算净收益	5,115.03

注：（1）利息收入金额 1,736.60 元，系以当前适用的利率计提的自 2018 年 3 月 20 日至 2018 年 4 月 17 日止清算期间的银行存款利息、存出保证金利息，以及债券利息。债券利息已于卖出债券时收回，银行存款利息由基金管理人以自有资金垫付，已于 2018 年 4 月 17 日划入托管账户。垫付资金在清算完成、托管账户销户时归还基金管理人。

（2）债券变现损益为本次清算期间债券资产变现金额扣除清算期间债券利息后，与最后运作日估值金额相减的差额。

（3）债券账户于 2018 年 3 月均已销户，系冲销之前预提的账户维护费。

（4）交易费用为本次清算期间债券资产变现所产生的交易费用。

5.4 清算费用

按照《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，本基金最后运作日后产生的律师费将由基金管理人代为承担。

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产情况

项目	金额
一、基金最后运作日2018年3月19日基金净资产	2,435,363.42
加：清算期间净收益	5,115.03
加：清算期间基金份额交易产生的净值影响（注）	-10,360.68
二、2018年4月17日基金剩余资产净值	2,430,117.77

注：本基金最后运作日为 2018 年 3 月 19 日，最后运作日交易申请的确认日为 2018 年 3 月 20 日。

截至本次清算期结束日 2018 年 4 月 17 日，本基金剩余财产为人民币 2,430,117.77 元。自本次清算期结束日次日（2018 年 4 月 18 日）至本次清算款划

出前一日的银行存款产生的利息（包括基金管理人垫付资金本金产生的利息）归基金份额持有人所有。

本基金所有剩余财产将按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5.6 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，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将根据法律法规及本基金的基金合同约定及时进行分配。

§6 备查文件

6.1 备查文件目录

- 1、海富通富源债券型证券投资基金 2018 年 3 月 19 日（基金最后运作日）资产负债表及审计报告
- 2、《海富通富源债券型证券投资基金清算报告》的法律意见

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内至基金管理人的办公场所免费查阅。

海富通富源债券型证券投资基金
基金财产清算小组

二〇一八年四月十七日

