

融通新动力灵活配置混合型证券投资基金

清算报告

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年七月十二日

报告公告日期：二〇一八年八月九日

一、重要提示

融通新动力灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]2285号《关于准予融通新动力灵活配置混合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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《融通新动力灵活配置混合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2017年8月3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《融通新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,提议终止《融通新动力灵活配置混合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7月3日表决通过了《关于终止融通新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,决定终止《融通新动力灵活配置混合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7月4日刊登在《证券时报》和基金管理人网站上的《关于融通新动力灵活配置混合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7月5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7月5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	融通新动力灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	融通新动力灵活配置混合
基金主代码	004508
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年8月3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(2018-7-	883,864.73份

4) 基金份额总额	
投资目标	在严格控制风险的前提下，投资于优质上市公司，并结合积极的大类资产配置，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、大类资产配置策略。本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，规避系统性风险。2、股票投资策略。本基金结合定量和定性分析，通过对上市公司基本面状况分析，财务分析和股票估值分析的三层分析来逐级优选股票，在确定优质备选行业的基础上，发掘技术领先、竞争壁垒明显、具有长期可持续增长模式并且估值水平相对合理的优质上市公司进行组合式投资。3、债券投资策略。在债券投资上，本基金贯彻“自上而下”的策略，采用三级资产配置的流程。包括久期管理、类属配置与组合优化以及通过因素分析决定个券选择。4、资产支持证券投资策略。本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。5、中小企业私募债投资策略。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。6、权证投资策略。本基金将在权证理论定价模型的基础上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。7、金融衍生工具投资策略。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合全价（总值）指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。

三、基金运作情况

本基金基金合同自 2017 年 8 月 3 日起正式生效。2017 年 8 月 3 日至 2018 年 7 月 4 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《融通新动力灵活配置

混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，提议终止《融通新动力灵活配置混合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7月3日进行，会议表决通过了《关于终止融通新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，并于2018年7月4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7月5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：融通新动力灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年7月4日

单位：人民币元

资产	2018年7月4日(基金最后运作日)
资产：	
银行存款	886,520.78
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中：债券投资	-
应收利息	298.99
资产总计	886,819.77
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	-
应付赎回费	-
应付管理人报酬	145.79
应付托管费	24.29
应付交易费用	-
应交税费	-
其他负债	-
负债合计	170.08
所有者权益：	
实收基金	883,864.73
未分配利润	2,784.96
所有者权益合计	886,649.69
负债和所有者权益总计	886,819.77

注：报告截止日 2018 年 7 月 4 日（基金最后运作日），基金份额净值 1.003 元，基金份额总额 883,864.73 份。

五、清算情况

自 2018 年 7 月 5 日至 2018 年 7 月 12 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《融通新动力灵活配置混合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，本基金的清算费用将由基金管理人支付。

2、资产处置情况

（1）本基金最后运作日的银行存款余额为人民币 886,520.78 元，该部分款项由基金托管人负责保管；

（2）本基金最后运作日应收利息人民币 298.99 元，该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，供清算分配使用，待结息日返还给基金管理人。

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 145.79 元，该款项已于 2018 年 7 月 5 日支付；

（2）本基金最后运作日应付托管费为人民币 24.29 元，该款项已于 2018 年 7 月 5 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 7 月 4 日基金净资产	886,649.69
加：清算期间（2018-7-5 至 2018-7-12）收入	
利息收入-银行存款利息收入（注 1）	141.84
减：清算期间（2018-7-5 至 2018-7-12）费用	

银行汇划费（注 2）	270.00
二、2018 年 7 月 12 日基金净资产	886,521.53

注：（1）利息收入暂以当前适用利率预估计提自 2018 年 7 月 5 日至 2018 年 7 月 12 日止（假定清算款划付日期为 2018 年 7 月 13 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）银行汇划费为清算期间的银行汇划费，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；

资产处置及负债清偿后，于 2018 年 7 月 13 日（假定清算款划付日期为 2018 年 7 月 13 日）本基金剩余财产为人民币 886,521.53 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 7 月 5 日至清算款实际划付日前一日的银行存款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，供清算分配使用。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）《融通新动力灵活配置混合型证券投资基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 7 月 4 日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告》

（2）关于《融通新动力灵活配置混合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：中国农业银行股份有限公司

2018年7月12日