

融通通颐定期开放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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018年10月15日

公告日期：2018年11月17日

一、重要提示

融通通颐定期开放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”）2016年10月9日下发的《关于准予融通通颐定期开放债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]2313号文）准予募集注册，经中国证监会2017年3月16日下发的《关于融通通颐定期开放债券型证券投资基金备案确认的函》（机构部函[2017]698号文）确认备案。本基金的基金合同生效日为2017年3月16日。基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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《融通通颐定期开放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》”）的有关规定，《基金合同》生效后，在任一开放期的最后一日日终，基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于5000万元，则无须召开基金份额持有人大会，本基金将根据基金合同的相关约定进行基金财产清算并终止。

本基金的第一个封闭期为自2017年3月16日起至2018年9月16日止，第一个开放期自2018年9月17日起至2018年9月28日止，截至开放期结束日（即2018年9月28日日终），本基金当日资产净值加上当日有效申购申请金额扣除当日有效赎回申请金额后的余额低于5000万元，已触发《基金合同》中约定的终止基金合同情形。本基金应当终止《基金合同》并按照《基金合同》的约定履行基金财产清算程序，且无须召开基金份额持有人大会。

本基金管理人已于2018年9月29日在《中国证券报》、《上海证券报》和基金管理人网站刊登了《融通基金管理有限公司关于融通通颐定期开放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》。依据公告，自2018年9月29日起，本基金进入清算程序，由基金管理人融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、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2018年9月29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，上海源泰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 融通通颐定期开放债券型证券投资基金

基金简称 融通通颐定期开放债券

基金主代码 003726

基金运作方式 契约型、定期开放式

基金合同生效日 2017年3月16日

基金管理人 融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

最后运作日 (2018-9-28)

基金份额总额 18,911,031.29 份

投资目标 根据本基金定期开放的运作特征，在严格控制风险和有效保持资产流动性的前提下，力争获得高于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、债券投资策略、股票投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略、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×80%+沪深300指数收益率×20%。

风险收益特征 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

三、基金运作情况

本基金基金合同自2017年3月16日起正式生效。2017年3月16日至2018年9月28日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

本基金的第一个封闭期为自2017年3月16日起至2018年9月16日止，第一个开放期为自2018年9月17日起至2018年9月28日止。截至开放期结束日（即2018年9月28日日终），本基金当日资产净值加上当日有效申购申请金额扣除当日有效赎回申请金额后的余额低于5000万元，已触发《基金合同》中约定的终止基金合同情形。本基金应当终止《基金合同》并按照《基金合同》的约定履行基金财产清算程序，且无须召开基金份额持有人大会。本基金于2018年9月29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：融通通颐定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2018年9月28日

单位：人民币元

资产 2018年9月28日(基金最后运作日)

银行存款 15,544,495.80

结算备付金 1,456,762.47

存出保证金 6,883.65

买入返售金融资产 25,000,215.00

应收利息 -1,555.67

资产合计 42,006,801.25

负债

应付证券清算款 2,986,816.44

应付赎回款 18,697,306.33

应付管理人报酬 87,920.90

应付托管费 25,120.28
应付销售服务费 13,783.03
应付交易费用 15,153.35
应交税费 13,754.56
其他负债 192,300.75
负债合计 22,032,155.64
所有者权益
实收基金 18,911,031.29
未分配利润 1,063,614.32
所有者权益合计 19,974,645.61
负债和所有者权益总计 42,006,801.25

注：报告截止日 2018 年 9 月 28 日（基金最后运作日），融通通颐定期开放债券 A 基金份额净值 1.0596 元，基金份额为 9,872,419.39 份；融通通颐定期开放债券 C 基金份额净值 1.0526 元，基金份额为 9,038,611.90 份；融通通颐定期开放债券基金份额净值 1.0562 元，基金份额总额 18,911,031.29 份。

五、清算情况

自 2018 年 9 月 29 日至 2018 年 10 月 15 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《融通通颐定期开放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

（1）本基金最后运作日的银行存款余额为人民币 15,544,495.80 元，该款项由基金托管人负责保管；

（2）本基金最后运作日结算备付金人民币 1,456,762.47 元，待实际划付清算款时，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）本基金最后运作日存出保证金人民币 6,883.65 元，待实际划付清算款时，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）本基金最后运作日买入返售金融资产人民币 25,000,215.00 元，该项资产均于 2018 年 10 月 8 日到期，到期后款项由基金托管人负责保管；

（5）本基金最后运作日应收利息人民币-1,555.67 元，其中：

应收银行存款利息为 7,476.58 元，应收备付金利息为 458.92 元，应收保证金利息为 2.17 元。待实际划付清算款时，该部分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，待结息日回款后再返还给基金管理人；

应收买入返售利息为-9,493.34 元，本基金计提至买入返售到期日合计后的利息由交易对手方返还给基金资产。

3、负债清偿情况

（1）本基金最后运作日应付证券清算款为人民币 2,986,816.44 元，该款项已于 2018 年 10 月 9 日划付；

（2）本基金最后运作日应付赎回款为人民币 18,697,306.33 元，该款项已于 2018 年 10 月

9日划付；

(3) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 87,920.90 元，该款项已于 2018 年 10 月 9 日支付；

(4) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 25,120.28 元，该款项已于 2018 年 10 月 9 日支付；

(5) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 13,783.03 元，该款项已于 2018 年 10 月 9 日支付；

(6) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 15,153.35 元，该款项待实际收缴时支付；

(7) 本基金最后运作日应交税费为人民币 13,754.56 元，该款项已于 2018 年 10 月 12 日支付；

(8) 本基金最后运作日其他负债为人民币 192,300.75 元，其中：
应付赎回费为人民币 0.75 元，该款项已于 2018 年 10 月 9 日支付；

应付审计费 30,000.00 元，该款项已于 2018 年 10 月 12 日支付；

应付信息披露费 140,000.00 元，该款项待实际收缴时支付；

应付律师费 10,000.00 元，该款项已于 2018 年 10 月 15 日支付；

应付账户维护费人民币 12,300.00 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 9 月 28 日基金净资产 19,974,645.61

加：清算期间（2018-9-29 至 2018-10-15）收入 30,392.79

利息收入-银行存款利息收入（注 1） 4,970.09

利息收入-结算备付金利息收入（注 1） 1,303.52

利息收入-存出保证金利息收入（注 1） 6.59

利息收入-应收买入返售证券利息收入 24,112.59

减：清算期间（2018-9-29 至 2018-10-15）确认的应付赎回款(注 2) 5,191,239.54

减：清算期间（2018-9-29 至 2018-10-15）费用 52.00

银行划款手续费 52.00

二、2018 年 10 月 15 日基金净资产 14,813,746.86

注：（1）利息收入暂以当前适用利率预估计提自 2018 年 9 月 29 日至 2018 年 10 月 15 日止（假定清算款划付日期为 2018 年 10 月 16 日）清算期间的银行存款利息、清算备付金利息和存出保证金利息，若清算款实际划付日期变更，该金额也将相应调整；

（2）2018 年 9 月 28 日申请的赎回于 2018 年 10 月 8 日确认，金额为 5,191,239.54 元，根据赎回的业务规则于 2018 年 10 月 10 日支付完毕。

资产处置及负债清偿后，于 2018 年 10 月 15 日（假定清算款划付日期为 2018 年 10 月 16 日）本基金剩余财产为人民币 14,813,746.86 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 9 月 29 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) 《融通通颐定期开放债券型证券投资基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 9 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《融通通颐定期开放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：中国工商银行股份有限公司

2018 年 10 月 15 日