

# 中融融丰纯债债券型证券投资基金清算报 告

基金管理人：中融基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

公告日期：2019年03月09日

## 一、重要提示及目录

### 1、重要提示

中融融丰纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”或“中融融丰纯债”)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)734号文注册,于2016年6月28日成立并正式运作,基金托管人为交通银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《中融融丰纯债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,中融基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)经与本基金的基金托管人交通银行股份有限公司协商一致,由基金管理人召集,以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会,审议终止本基金基金合同相关事项的议案。本基金份额持有人大会已于2018年12月10日表决通过了《关于终止中融融丰纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,决定终止本基金基金合同。基金份额持有人大会的表决结果暨决议生效的公告详见2018年12月12日刊登在《证券日报》和基金管理人网站(www.zrfunds.com.cn)上的《关于中融融丰纯债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》。

本基金自2018年12月12日起进入清算程序。由基金管理人中融基金管理有限公司、基金托管人交通银行股份有限公司、上会会计师事务所(特殊普通合伙)、上海市通力律师事务所于2018年12月12日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由上会会计师事务所(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

1、基金名称：中融融丰纯债债券型证券投资基金

2、基金简称：中融融丰纯债(基金代码：002674)、中融融丰纯债A(基金代码：002674)、中融融丰纯债C(基金代码：002675)

3、基金运作方式：契约型开放式

4、基金合同生效日：2016年6月28日

5、2018年12月11日(基金最后运作日)基金份额总额：6,683,585.81份

其中：中融融丰纯债A 5,426,980.52份、中融融丰纯债C 1,256,605.29份

6、投资目标：在控制组合净值波动率的前提下,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。

7、投资策略：本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,动态调整大类金融资产比例,自上而下决定债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略,在严谨深入的分析基础上,综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,深入挖掘价值被低估的标的券种。

### 1、大类资产配置

### 2、债券投资策略

#### (1) 久期管理策略

#### (2) 期限结构配置策略

#### (3) 债券的类别配置策略

#### (4) 骑乘策略

#### (5) 杠杆放大策略

(6) 信用债券投资策略

(7) 资产支持证券投资策略

(8) 中小企业私募债券投资策略

8、业绩比较基准：中债总指数（全价）

9、风险收益特征：本基金为债券型基金，属于证券市场中的较低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

10、基金管理人：中融基金管理有限公司

11、基金托管人：交通银行股份有限公司

### 三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：中融融丰纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2018年12月11日

单位：人民币元

项目 基金最后运作日 2018年12月11日

资产：

银行存款 47,980.41

清算备付金 21,617.10

存出保证金 503.80

债券投资 2,750,111.40

应收利息 55,693.88

其他应收款 1,155,000.00

证券清算款 70,812.95

资产合计 4,101,719.54

负债：

应付赎回款 86,002.83

应付赎回费 26.89

应付管理人报酬 1,157.31

应付托管费 330.65

应付销售服务费 295.43

其他应付款 470,000.00

预提费用 117,684.08

负债合计 675,497.19

所有者权益：

实收基金 6,683,585.81

未分配利润 -3,257,363.46

所有者权益合计 3,426,222.35

负债及所有者权益合计 4,101,719.54

### 四、清算事项说明

#### 1、基本情况

本基金经中国证监会证监许可〔2016〕734号文《关于准予中融融丰纯债债券型证券投资基金注册的批复》批准，由基金管理人中融基金管理有限公司依照《基金法》、《运作办法》和《基金合同》进行公开

募集，并于2016年6月28日募集成立。本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金的投资对象是具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、逆回购、央行票据、同业存单、银行存款等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的业绩比较基准为：中债总指数（全价）。

## 2、清算原因

根据《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”中“二、基金合同的终止事由”的约定：

“有下列情形之一的，基金合同应当终止： 1. 基金份额持有人大会决定终止的； 2. 基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的； 3. 基金合同约定的其他情形； 4. 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。”

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《中融融丰纯债债券型证券投资基金基金合同》有关规定，基金管理人经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，提议终止《中融融丰纯债债券型证券投资基金基金合同》。本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议并通过了终止基金合同相关事项的议案，并依法履行基金财产清算程序。

## 3、清算起始日

根据《基金合同》及《关于中融融丰纯债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》，2018年12月11日为基金最后运作日，本基金于2018年12月12日进入清算期，故本基金清算起始日为2018年12月12日。

## 4、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。本基金自最后运作日起，资产负债按实际清算价格计价。

## 五、清算情况

自2018年12月12日至2018年12月28日止为本基金清算报告期，中融融丰纯债基金自清算起始日起，中融融丰纯债基金财产清算小组成立，并对中融融丰纯债基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行，具体情况如下：

### 1、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款人民币47,980.41元，清算期间支付赎回款、赎回费共计人民币50,253.27元，支付中债账户维护费人民币4,500.00元，支付上清所账户维护费4,500.00元，归还管理人垫款470,000.00元，支付汇划费5.00元。

(2) 本基金最后运作日清算备付金人民币21,617.10元，存出保证金人民币503.80元，存出保证金将于2019年1月3日由中国证券登记结算有限责任公司返还至托管户。

(3) 本基金最后运作日证券清算款70,812.95元，该款项于2018年12月12日转入托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收银行存款利息人民币776.12元、应收存出保证金利息人民币6.18元，应收结算备付金利息人民币49.80元，共计832.10元，该款项将于2018年12月21日结至托管账户。应收债券利息人民币54,861.78元，该款项将于债券变现后结至托管账户。

(5) 本基金最后运作日债券投资为人民币2,750,111.40元(最后运作日估值金额)。

(6) 本基金最后运作日其他应收款人民币1,155,000.00元，为本基金持有的债券14富贵鸟(代码122356)未兑付的款项(最后运作日估值金额)。

### 2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日融丰纯债A级、C级应付赎回款合计为人民币86,002.83元，应付赎回费合计为人民币26.89元，分别于2018年12月12日、12月13日从托管账户划出。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,157.31 元, 该款项将于清算完成后从托管账户划出。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 330.65 元, 该款项将于清算完成后从托管账户划出。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 295.43 元, 该款项将于清算完成后从托管账户划出。

(5) 本基金最后运作日其他应付款为人民币 470,000.00 元, 该款项为管理人垫付款, 于 2018 年 12 月 19 日归还管理人账户。

(6) 本基金最后运作日预提费用人民币 117,684.08 元, 其中审计费用人民币 14,138.40 元, 该款项将于清算完成后从托管账户划出; 信息披露费人民币 94,245.68 元, 该款项将于取得信息披露费发票后从托管账户划出; 银行间账户维护费人民币 9,000.00 元, 于 2018 年 12 月 19 日、12 月 27 日从托管账户划出, 账户查询费 300.00 元, 将于取得上清所缴费单后支付。

### 3、所有者权益情况

最后运作日基金净资产为 3,426,222.35 元, 基金份额共 6,683,585.81 份, 其中中融融丰纯债A份额 5,426,980.52 份、中融融丰纯债C份额 1,256,605.29 份; 清算结束日本基金剩余财产为 3,426,229.81 元, 基金份额共 6,683,585.81 份, 其中中融融丰纯债A份额 5,426,980.52 份、中融融丰纯债C份额 1,256,605.29 份。

### 4、清算期间的清算损益情况

项目 清算期发生额

#### 一、清算期间收入

1、存款利息收入(注1) 1,807.20

2、债券利息收入(注2) 340.22

3、投资收益 -2,118.60

其中: 公允价值变动损益 -1,548.68

清算期间收入小计 28.82

#### 二、清算期间费用(注3)

1、交易费用 16.36

2、银行划款手续费 5.00

3、律师费 -

4、公证费 -

清算期间费用小计 21.36

#### 三、清算净收益(清算净损失以“-”表示) 7.46

注 1: 存款利息收入包括中融融丰纯债债券型证券投资基金清算起始日 2018 年 12 月 12 日至 2018 年 12 月 28 日形成的银行存款利息收入 1,790.13 元、备付金利息收入 16.45 元、保证金利息收入 0.62 元, 共计 1,807.20 元; 债券利息收入为清算期间变现债券投资所得利息收入。

注 2: 清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用, 按照《基金合同》约定, 清算费用应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, 本基金清算费用中的律师费和公证费将由基金管理人代为支付。

### 5、清算结束日的资产负债及剩余财产的分配情况

单位: 人民币元

项目 金额

一、最后运作日 2018 年 12 月 11 日基金净资产 3,426,222.35

加: 清算期间净收益 7.46

二、清算结束日 2018 年 12 月 28 日基金净资产 3,426,229.81

根据《基金合同》中关于基金财产清算的相关约定, 基金财产清算小组将依据基金财产清算的分配方

案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用（基金管理人代为支付的部分除外）、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。同时，《基金合同》“第七部分 基金合同当事人及权利义务”中“三、基金份额持有人”项下约定：“每份基金份额具有同等的合法权益。”。基金财产将按照上述分配原则进行分配。

本基金清算报告期终止日的其他应收款金额由基金管理人中融基金管理有限公司以自有资金垫付至托管账户，本基金清算起始日 2018 年 12 月 12 日至基金财产清算款划出日前一日的银行存款和存出保证金产生的利息亦属基金份额持有人所有。如前述利息在本基金财产分配划出日前尚未结清，则未结息部分将由基金管理人中融基金管理有限公司以自有资金垫付至托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有，基金管理人所垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于利息结清后返还给基金管理人，基金财产清偿完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

#### 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，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，将报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

#### 六、备查文件目录

##### 1、备查文件目录

(1)《中融融丰纯债债券型证券投资基金清算审计报告》；

(2)《通力律师事务所关于<中融融丰纯债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。

中融融丰纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

2019 年 01 月 22 日