

海富通聚丰纯债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：上海浦东发展银行股份有限公司

清算报告出具日期：二〇二〇年四月二十七日

清算报告公告日期：二〇二〇年六月三日

§ 1 重要提示

海富通聚丰纯债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【2018】1297号《关于准予海富通聚丰纯债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”),基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(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。《海富通聚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》”)于2018年11月30日正式生效。截至2020年3月25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,根据基金合同约定,基金管理人与基金托管人协商一致后,不需召开基金份额持有人大会,决定终止本基金基金合同并依法履行基金财产清算程序。基金管理人已就该事项于2020年3月27日在《中国证券报》及公司网站刊登了《海富通基金管理有限公司关于海富通聚丰纯债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2020年3月27日,并于2020年3月28日进入清算程序。

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2020年3月27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 海富通聚丰纯债债券型证券投资基金

基金简称 海富通聚丰纯债

基金主代码 006472

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2018年11月30日

基金最后运作日(2020年3月27日)基金份额总额 277,336.22份

投资目标 在严格控制风险的基础上,追求基金资产长期稳定增值,力争实现高于业绩比较基准的投资收益。

投资策略

本基金为债券型基金,对债券的投资比例不低于基金资产的80%。在此约束下,本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析,对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪,从而决定其配置比例。本基金的投资策略包括资产配置策略、债券类属资产配置、债券投资组合策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略。

业绩比较基准 中证全债指数收益率

风险收益特征 本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于

混合型基金、股票型基金。

基金管理人 海富通基金管理有限公司

基金托管人 上海浦东发展银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可【2018】1297号《关于准予海富通聚丰纯债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，基金简称为海富通聚丰纯债(基金代码：006472)。《海富通聚丰纯债债券型证券投资基金基金合同》于2018年11月30日正式生效，共募集300,201,474.06份基金份额。截至2020年3月27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2020年3月27日，清算期间为2020年3月28日至2020年4月27日。

§ 4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：海富通聚丰纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2020年03月27日

单位：人民币元

资产 基金最后运作日

2020年03月27日

资产：

银行存款 495,074.71

结算备付金 248.46

存出保证金 3,031.25

交易性金融资产 37,087.50

其中：债券投资 37,087.50

应收利息 1,081.17

资产总计 536,523.09

负债和所有者权益 基金最后运作日

2020年03月27日

负债：

应付赎回款 41,171.36

应付管理人报酬 23.80

应付托管费 7.90

应付交易费用 1,899.15

其他负债 204,346.81

负债合计 247,449.02

所有者权益：

实收基金 277,336.22

未分配利润 11,737.85

所有者权益合计 289,074.07

负债和所有者权益总计 536,523.09

注：本基金最后运作日 2020 年 03 月 27 日，基金份额净值 1.0423 元，基金份额总额 277,336.22 份。

4.2 利润表

会计主体：海富通聚丰纯债债券型证券投资基金

报告期间：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 03 月 27 日(基金最后运作日)

项目

本期

2020 年 01 月 01 日至 2020 年 03 月 27 日(基金最后运作日)

一、收入 1,027.83

利息收入 1,107.98

其中：存款利息收入 802.67

债券利息收入 305.31

投资收益(损失以“-”填列) -36.20

其中：债券投资收益 -36.20

公允价值变动收益(损失以“-”号填列) -83.60

其他收入(损失以“-”号填列) 39.65

减：二、费用 263.98

管理人报酬 54.59

托管费 18.23

交易费用 1.16

利息支出

其中：卖出回购金融资产支出

其他费用 190.00

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) 763.85

减：所得税费用

四、净利润(净亏损以“-”号填列) 763.85

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、沈兆杰签字出具了普华永道中天特审字(2020)第 2117 号标准无保留意见的审计报告。

§ 5 基金财产分配

本基金自 2020 年 03 月 28 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。本次具体清算情况如下：

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日结算备付金金额 248.46 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的上交所最低结算备付金。中国证券登记结算有限责任公司每月初第 2 个工作日对最低结算备付金进行调整，本基金已于 2020 年 4 月 2 日全部收回结算备付金 248.46 元。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金金额 3,031.25 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的交易所结算保证金。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 2020 年 4 月 2 日全部收回存出保证金 3,031.25 元。

5.1.3 本基金最后运作日持有以下债券：

债券代码 债券名称 数量(张) 期末成本总额 期末估值总额

018061 进出 1911 170 17,059.50 17,059.50

108602 国开 1704 200 20,110.00 20,028.00

合计 370 37,169.50 37,087.50

截至 2020 年 4 月 27 日（本次清算期结束日），上述债券已全部卖出，卖出总金额 38,050.95 元，其中包含应收利息 969.48 元，卖出净价金额 37,081.90 元，交易费用 0.43 元。

5.1.4 本基金最后运作日应收利息为 1,081.17 元。其中应收活期银行存款利息为 120.31 元，应收备付金利息为 0.07 元，应收保证金利息金额为 0.98 元，应收债券利息 959.81 元。应收债券利息已于卖出债券时收回，应收活期银行存款利息、应收备付金利息和应收保证金利息预计于 2020 年 6 月 22 日结息时收回。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款 41,171.36 元，已于 2020 年 03 月 30 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬 23.80 元，已于 2020 年 04 月 02 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费 7.90 元，已于 2020 年 04 月 02 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付交易费用为 1,899.15 元，已于 2020 年 04 月 20 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日其他负债 204,346.81 元，其中包括：

5.2.5.1 本基金最后运作日应付赎回费 30.93 元，已于 2020 年 03 月 30 日支付。

5.2.5.2 本基金应归还公司垫资款 18,315.88 元，将根据实际发生费用支付情况进行处置。

5.2.5.3 应付截止 2019 年末审计费 66,000.00 元，将在收到会计师事务所审计费发票后支付。

5.2.5.4 应付截止 2019 年末信息披露费 120,000.00 元，将在收到报社发票后支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目 自 2020 年 03 月 28 日至 2020 年 04 月 27 日（本次清算期截止日）止

一、清算收益

1、利息收入（注 1） 563.07

2、债券变现损益（注 2） -5.60

3、其他收入 149.65

清算收入小计 707.12

二、清算费用

1、交易费用（注 4） 0.43

2、银行汇划手续费 35.00

清算费用小计 35.43

三、清算净收益 671.69

注：

（1）利息收入金额 563.07 元，系以当前适用的利率计提的自 2020 年 3 月 28 日至 2020 年 4 月 27 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息以及持有债券的利息收入。

（2）债券变现损益为本次清算期间债券资产卖出金额扣除截止变现日应收债券利息后，与最后运作日估值金额的差额。

（3）其他收入为赎回费收入。

（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

根据本基金合同第十九部分相关约定，基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生

的所有合理费用属于清算费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

本基金清算期间发生的交易费用、银行汇划手续费从基金财产中支付。

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产情况

项目 金额

一、最后运作日 2020 年 03 月 27 日基金净资产 289,074.07

加：清算期间净收益 671.69

加：清算期间基金份额交易产生的净值影响（注） -20,941.06

二、2020 年 04 月 27 日基金剩余资产净值 268,804.70

注：本基金最后运作日为 2020 年 03 月 27 日，最后运作日交易申请的确认日为 2020 年 03 月 30 日。

截至本次清算期结束日 2020 年 04 月 27 日，本基金剩余财产 268,804.70 元。自本次清算期结束日次日(2020 年 04 月 28 日)至托管账户销户之日的银行存款产生的利息归基金份额持有人所有。基金管理人将在按照中国证监会的规定履行完关于清算备案的程序后，先将本基金托管账户内现金资产支付给基金份额持有人，待托管账户销户后，再将本基金剩余财产全部分配给基金份额持有人。

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分配。待基金托管账户销户后，基金管理人将对剩余资产进行最终分配，届时将不再另行公告。

§ 6 备查文件

6.1 备查文件目录

1、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金 2020 年 3 月 27 日（基金最后运作日）资产负债表及审计报告

2、《海富通聚丰纯债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。

海富通聚丰纯债债券型证券投资基金

基金财产清算小组

二〇二〇年四月二十七日