

富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证 券投资基金清算报告

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

清算报告出具日：2020 年 10 月 26 日

清算报告公告日：2020 年 10 月 27 日

一、重要提示及目录

1、重要提示

富兰克林国海日鑫月益 30 天理财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[2013]257 号文核准,并依据中国证监会机构部函[2017]983 号文募集,由国海富兰克林基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集(不包括认购资金利息)共人民币 1,559,151,732.81 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 647 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 6 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,559,391,632.36 份,其中认购资金利息折合 239,899.55 份基金份额。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

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《富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,提议终止《富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券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,大会投票时间自 2020 年 9 月 11 日起,至 2020 年 10 月 12 日 17:00 止。会议已于 2020 年 10 月 13 日表决通过了《关于终止富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,决定终止《富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券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 2020 年 10 月 14 日刊登在《证券时报》和基金管理人网站上的《国海富兰克林基金管理有限公司关于富兰克林国海日鑫月益 30 天理财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》。

本基金于 2020 年 10 月 14 日起进入清算程序,由基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、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 2020 年 10 月 14 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。

2、目录

一、重要提示及目录.....	1
1、重要提示.....	1
2、目录.....	2
二、基金概况.....	3
三、财务会计报告.....	4
四、清盘事项说明.....	5
1、清算原因.....	5
2、清算起始日.....	5
3、清算报表编制基础.....	5
五、清算情况.....	5
1、清算费用.....	6
2、资产处置情况.....	6
3、负债清偿情况.....	6
4、清算期的清算损益情况.....	7
5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况.....	8
6、基金财产清算报告的告知安排.....	9
六、备查文件目录.....	9
1、备查文件目录.....	9
2、存放地点.....	9
3、查阅方式.....	9

二、基金概况

基金名称	富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金	
基金简称	国富日鑫月益 30 天理财债券	
基金主代码	004663	
下属分级基金的基金简称	国富日鑫月益 30 天理财债券 A	国富日鑫月益 30 天理财债券 B
下属分级基金的交易代码	004663	004664
基金运作方式	<p>契约型开放式</p> <p>(1) 每个运作周期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请</p> <p>对于每份基金份额，第一个运作周期指基金合同生效日或基金份额申购确认日起（即第一个运作起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日次一个月的月度对日（即第一个运作周期到期日。如该对应日为非工作日，则顺延到下一工作日）止。第二个运作周期指第一个运作周期到期日的次一工作日起，至基金合同生效日或基金份额申购申请日对应的次二个月的月度对日（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）止。以此类推。</p> <p>每个运作周期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请。</p> <p>(2) 每个运作周期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请</p> <p>每个运作周期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作周期到期日未申请赎回，则自该运作周期到期日下一工作日起该基金份额进入下一个运作周期。</p> <p>在基金份额对应的每个运作周期到期日，基金管理人办理该基金份额对应的未支付收益的结转。</p>	

基金合同生效日	2017 年 6 月 19 日
基金最后运作日	2020 年 10 月 13 日
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
注册登记机构	国海富兰克林基金管理有限公司

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 10 月 13 日

单位：人民币元

	最后运作日 2020 年 10 月 13 日
资 产：	
银行存款	88,211,050.12
结算备付金	3,455,909.09
存出保证金	-
交易性金融资产	45,292,007.26
其中：债券投资	45,292,007.26
买入返售金融资产	81,946,362.92
应收证券清算款	19,970,125.71
应收利息	270,663.60
其他资产	-
资产总计	239,146,118.70
负 债：	
应付赎回款	-
应付管理人报酬	48,553.83
应付托管费	13,872.49
应付销售服务费	5,552.66
应付交易费用	69,148.88
应付税费	8,064.45
应付利润	337,571.04
其他负债	210,271.66
负债合计	693,035.01
所有者权益：	
实收基金	238,453,083.69
未分配利润	-

所有者权益合计	238,453,083.69
负债和所有者权益总计	239,146,118.70

四、清盘事项说明

1、清算原因

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《富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，提议终止《富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券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，大会投票时间自 2020 年 9 月 11 日起，至 2020 年 10 月 12 日 17:00 止。会议已于 2020 年 10 月 13 日表决通过了《关于终止富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，决定终止《富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金基金合同》。

2、清算起始日

本基金于 2020 年 10 月 14 日起进入清算程序，清算期间为 2020 年 10 月 14 日至 2020 年 10 月 26 日。

3、清算报表编制基础

本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。本基金已将账面价值高于预计可收回金额的资产调整至预计可收回金额，并按预计结算金额计量负债。同时，不对资产、负债进行流动与非流动的划分。本清算报表只列示最后运作日 2020 年 10 月 13 日的资产负债表，不列示比较数据。

五、清算情况

自 2020 年 10 月 14 日至 2020 年 10 月 26 日止的清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，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：

1、清算费用

按照《富兰克林国海日鑫月益 30 天理财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财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 3,455,909.09 元。将根据中国证券登记结算有限责任公司关于结算备付金调整的规则，于收到退回的结算备付金时划入托管户。

(2) 本基金最后运作日持有 53,000 张 20 贴现国债 37，账面价值为：5,289,586.76 元。此证券已于 2020 年 10 月 15 日卖出，实际清算金额为：5,289,612.06 元。该款项已于 2020 年 10 月 15 日划入基金托管户。

本基金最后运作日持有 400,000 张 20 海通证券 CP006，账面价值为：40,002,420.50 元。此证券已于 2020 年 10 月 16 日到期兑付派息，实际兑付派息金额为：40,243,123.29 元。该款项已于 2020 年 10 月 16 日划入基金托管户。

(3) 本基金最后运作日持有的买入返售金融资产为人民币 81,946,362.92 元，实际清算金额为 82,034,912.08 元。该款项已于 2020 年 10 月 16 日划入基金托管户。

(4) 本基金最后运作日的应收证券清算款余额为 19,970,125.71 元。该款项已于 2020 年 10 月 14 日划入基金托管户。

(5) 本基金最后运作日的应收利息余额为人民币 270,663.60 元，其中应收活期存款利息人民币 3,412.43 元；应收结算备付金利息人民币 1,429.27 元；应收债券利息人民币 190,027.40 元，已于 2020 年 10 月 16 日债券到期兑付时划入托管户；应收买入返售证券应收利息 75,794.50 元，已于 2020 年 10 月 16 日到期划入托管户。2020 年 10 月 14 日至清算款划出日前一日银行存款、结算备付金孳生的利息归基金份额持有人所有，该款项将由基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司以自有资金垫付，并在清算款划出日前一日划至本基金的基金托管户。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。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付基金管理人报酬为人民币 48,553.83 元，该款项已于

2020 年 10 月 14 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 13,872.49 元，该款项已于 2020 年 10 月 14 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 5,552.66 元，该款项已于 2020 年 10 月 14 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 69,148.88 元，已于 2020 年 10 月 16 日支付 67,495.58 元，剩余款项待收到缴费通知单后支付。

(5) 本基金最后运作日应交税费为人民币 8,064.45 元，该款项已分别于 2020 年 10 月 15 日、2020 年 10 月 19 日支付。

(6) 本基金最后运作日应付利润为人民币 337,571.04 元，已分别于 2020 年 10 月 14 日、2020 年 10 月 15 日转为基金份额。

(7) 本基金最后运作日应付审计费为人民币 60,000.00 元，该款项将于清算期结束后支付给审计机构。

(8) 本基金最后运作日账面预提信息披露费为人民币 100,000.00 元，该款项将于清算期结束后支付给信息披露服务机构。

(9) 本基金最后运作日账面预提银行间账户维护费为人民币 10,271.66 元，已于 2020 年 10 月 16 日支付 9,000.00 元，剩余款项待收到缴费通知单后支付。

(10) 本基金最后运作日应付律师费为人民币 30,000.00 元，该款项将于清算期结束后支付给律师事务所。

(11) 本基金最后运作日应付公证费为人民币 10,000.00 元，该款项已于 2020 年 10 月 14 日支付。

4、清算期的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2020 年 10 月 14 日 至 2020 年 10 月 26 日
一、收入	92,631.62
1. 利息收入	93,084.82
其中：存款利息收入	27,317.89
结算备付金利息收入	2,021.63
结算保证金利息收入	-
买入返售金融资产收入	12,754.66
债券利息收入	50,990.64
2. 投资收益（损失以“-”号填列）	-453.20

其中：债券投资收益	-453.20
3. 公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”填列）	-
二、费用	2,188.34
1. 管理人报酬	-
2. 托管费	-
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	-
5. 利息支出	-
6. 清算费用	-
7. 其他费用（注 1）	2,188.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	90,443.28
减：所得税费用	-
四、净利润总额（净亏损以“-”号填列）	90,443.28

注 1：其他费用为银行汇划费和银行间债券账户维护费。

5、资产处置及负债清偿后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 2020 年 10 月 13 日基金净资产	238,453,083.69
加：清算期净收益	90,443.28
加：应付利润结转实收基金金额	337,571.04
减：最后运作日有效赎回申请对应赎回款	234,855.63
二、2020 年 10 月 26 日基金净资产	238,646,242.38

资产处置及负债清偿后，于 2020 年 10 月 26 日本基金剩余财产为人民币 238,646,242.38 元，根据《富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金基金合同》约定，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、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。

2020 年 10 月 14 日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金产生的利息亦属基金份额持有人所有，该部分利息将由国海富兰克林基金管理有限公司以自有资金先行垫付，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。

基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司以自有资金先行垫付的款项以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

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，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

(1) 富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金资产负债表及审计报告；

(2) 《关于<富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金清算报告>的法律意见》。

2、存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人网站 <http://www.ftsfund.com>，中国证监会基金电子披露网站 <http://eid.csrc.gov.cn/fund>。

3、查阅方式

投资者可登录基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金基金财产清算小组

2020 年 10 月 26 日