

融通通启一年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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年十二月十五日

公告日期：二〇二〇年十二月十八日

一、重要提示

融通通启一年定期开放债券型证券投资基金是由融通月月添利定期开放债券型证券投资基金转型而来。2020年5月25日融通月月添利定期开放债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于融通月月添利定期开放债券型证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》。自2020年6月2日起，《融通通启一年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”）生效，《融通月月添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。融通通启一年定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人为融通基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国农业银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《基金合同》约定，截至本基金本次开放期最后一日（即2020年11月26日）日终，本基金当日资产净值加上当日申购及转换入申请金额扣除当日赎回及转换出申请金额后，基金资产净值低于5000万元，触发了《基金合同》“第五部分 基金的存续”之“二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”中约定的基金合同自动终止情形。为保护投资者利益，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。基金管理人于2020年11月27日发布《融通基金管理有限公司关于融通通启一年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》，具体详见基金管理人相关公告。

本基金自2020年11月27日起进入清算期，根据《基金合同》的相关约定，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	融通通启一年定期开放债券型证券投资基金
基金简称	融通通启一年定开债券
基金主代码	000437
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2020年6月2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(2020-11-26)基金份额总额	541,063,346.26 份	
下属分级基金的基金简称	融通通启一年定开债券 A	融通通启一年定开债券 B
下属分级基金的交易代码	000437	000438
最后运作日(2020-11-26)下属分级基金的份额总额	539,838,430.24 份	1,224,916.02 份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金主要投资于固定收益类品种,不直接买入股票等金融工具。本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配。本基金的具体投资策略包括资产配置策略、利率策略、信用策略、类属配置与个券选择策略、可转换债券投资策略、资产支持证券以及国债期货的投资策略等部分。	
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	

三、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:融通通启一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2020年11月26日(基金最后运作日)

单位:人民币元

资产	2020年11月26日(基金最后运作日)
资产:	
银行存款	93,670,999.40
结算备付金	3,081,375.41
存出保证金	10,177.38
交易性金融资产	603,716,528.80
其中:债券投资	573,800,528.80
资产支持证券投资	29,916,000.00
应收利息	10,855,846.45
应收证券清算款	81,432,890.70
应收申购款	133,268.90
资产总计	792,901,087.04
负债和所有者权益	
负债:	
卖出回购金融资产款	131,163,363.25
应付赎回款	104,358,684.40
应付管理人报酬	188,820.69
应付托管费	47,205.17

应付销售服务费	536.88
应付交易费用	8,406.50
应付税费	73,906.76
应付利息	66,844.55
其他负债	185,575.99
负债合计	236,093,344.19
所有者权益：	
实收基金	541,063,346.26
未分配利润	15,744,396.59
所有者权益合计	556,807,742.85
负债和所有者权益总计	792,901,087.04

注：基金最后运作日 2020 年 11 月 26 日，基金份额总额 541,063,346.26 份，其中融通通启一年定开债 A 基金份额总额为 539,838,430.24 份，基金份额净值 1.0291 元；融通通启一年定开债 B 基金份额总额为 1,224,916.02 份，基金份额净值 1.0267 元。

四、清算情况

自 2020 年 11 月 27 日至 2020 年 12 月 14 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《融通通启一年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 93,670,999.40 元，该部分款项由基金托管人负责保管。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 3,081,375.41 元，该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 10,177.38 元，该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管。

(4) 本基金最后运作日应收利息人民币 10,855,846.45 元。

(5) 本基金最后运作日应收申购款 133,268.90 元，该款项已于 2020 年 11 月 27 日与 11 月 30 日划入基金财产。

(6) 本基金最后运作日应收证券清算款 81,432,890.70 元，该款项已于 2020 年 11 月

27日划入基金财产。

(7) 本基金最后运作日持有的金融资产为人民币 603,716,528.80 元, 具体明细如下:

序号	证券名称	证券代码	数量(张)	最后运作日估值金额 (元)
1	PR 武清 02	124590	131,000	2,638,340.00
2	PR 韶关债	139260	200,000	13,656,000.00
3	15 华夏 05	122494	41,320	4,060,929.60
4	18 华夏 01	143550	100,000	9,799,000.00
5	18 伊泰 01	143673	100,000	10,085,000.00
6	18 伊泰 02	155118	100,000	10,044,000.00
7	19 华夏 01	155273	70,000	6,983,200.00
8	19 云投 01	155280	99,720	9,559,159.20
9	19 宏泰债	155394	100,000	10,086,000.00
10	20 世茂 G1	163216	200,000	19,610,000.00
11	16 魏桥 03	112359	60,000	5,726,400.00
12	20 中证 Y1	149143	200,000	19,536,000.00
13	20 川能 Y1	149279	300,000	29,727,000.00
14	16 柯桥国资 MTN001	101659041	100,000	9,962,000.00
15	16 甘电投 MTN001	101672001	100,000	10,051,000.00
16	16 威宁投资 MTN002	101682006	100,000	9,968,000.00
17	17 鲁宏桥 MTN001	101762001	100,000	9,055,000.00
18	17 晋路桥 MTN002	101769025	100,000	10,558,000.00
19	18 云城投 MTN005	101800648	100,000	9,997,000.00
20	18 鞍钢 MTN002	101801353	200,000	20,030,000.00
21	18 津保投 MTN015	101801519	100,000	10,042,000.00
22	19 河钢集 MTN002A	101900193	100,000	10,090,000.00
23	19 鞍钢 MTN002	101900361	100,000	10,061,000.00
24	19 红狮 MTN001B	101900691	200,000	20,176,000.00
25	19 阳煤 MTN002	101900812	100,000	9,972,000.00
26	19 鲁钢铁 MTN002	101900877	300,000	29,796,000.00
27	19 淮北矿 MTN002	101901092	100,000	9,976,000.00
28	19 兖矿 MTN004	101901145	100,000	10,049,000.00
29	19 江东控股 MTN001	101901224	100,000	10,073,000.00
30	19 阳煤 MTN005	101901404	100,000	9,811,000.00
31	19 岳阳水利 MTN001	101901646	100,000	9,997,000.00
32	20 晋能 MTN001	102000011	300,000	29,811,000.00
33	20 庐江城投 MTN001	102000016	200,000	19,862,000.00
34	20 伊犁财通 MTN001	102000086	100,000	9,982,000.00
35	20 远东租赁 MTN001	102000137	100,000	9,917,000.00
36	20 苏沙钢 MTN003	102000248	100,000	9,786,000.00
37	20 济源建投 MTN001	102000396	200,000	19,776,000.00
38	20 阳煤 MTN002	102000410	100,000	9,700,000.00

39	20 潞安 MTN002	102000601	300,000	29,178,000.00
40	20 赣金控 MTN001	102000824	100,000	9,752,000.00
41	20 铜陵有色 MTN001	102002092	250,000	24,942,500.00
42	20 大连万达 MTN005	102002131	300,000	29,919,000.00
43	开新 10 优	169328	300,000	29,916,000.00

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 188,820.69 元, 该款项已于 2020 年 12 月 2 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 47,205.17 元, 该款项已于 2020 年 12 月 2 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付应付销售服务费为人民币 536.88 元, 该款项已于 2020 年 12 月 2 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 8,406.50 元, 该款项将于费用缴付日划出。

(5) 本基金最后运作日应付税费为人民币 73,906.76 元, 该款项已于 2020 年 12 月 9 日支付。

(6) 本基金最后运作日应付利息为人民币 66,844.55 元, 该款项已于 2020 年 11 月 27 日支付。

(7) 本基金最后运作日应付赎回/转出款为人民币 104,358,684.40 元, 该款项已于 2020 年 11 月 27 日和 11 月 30 日支付。

(8) 本基金最后运作日应付卖出回购金融资产款 131,163,363.25 元, 该款项已于 2020 年 11 月 27 日支付。

(9) 本基金最后运作日其他负债为人民币 185,575.99 元, 该款项包含本基金最后运作日应付预提审计费 60,000.00 元, 预提信息披露费 120,000.00 元, 预提中债登账户维护费 2,787.87 元, 预提上清所账户维护费 2,787.87 元, 应付赎回费 0.25 元。其中应付赎回费已于 2020 年 11 月 30 日支付。

4、清算期间的剩余资产分配情况

项目	金额 (元)
一、最后运作日 2020 年 11 月 26 日基金净资产	556,807,742.85
加: 清算期间 (2020-11-27 至 2020-12-14) 收入	479,952.88
存款利息收入	53,446.04

债券利息收入	917,596.65
债券投资收益	-4,575,756.45
公允价值变动损益	4,084,666.64
减：清算期间（2020-11-27至2020-12-14）费用	9,054.94
交易费用	3,990.76
税费	3,303.42
债券账户维护费	1,760.76
二、2020年12月14日基金净资产	557,278,640.79
三、首次划付金额：	330,000,000.00

注：（1）首次清算款划付金额以截至本次清算结束日已变现情况为基准划付。

（2）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，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。由于本基金截至清算期结束日（2020年12月14日）所持未变现债券，本基金将根据变现情况进行后续清算流程，并将清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用、缴纳税款并清偿债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5、本次清算结束日（2020年12月14日）金融资产为人民币214,976,436.40元，具体明细如下：

序号	证券名称	证券代码	数量（张）	最后运作日估值金额（元）
1	PR 韶关债	139260	200,000	13,662,000.00
2	15 华夏 05	122494	41,320	4,025,394.40
3	18 华夏 01	143550	99,990	9,579,042.00
4	18 伊泰 02	155118	100,000	10,053,000.00
5	17 鲁宏桥 MTN001	101762001	100,000	8,908,000.00
6	18 云城投 MTN005	101800648	100,000	10,007,000.00
7	18 津保投 MTN015	101800649	100,000	10,037,000.00
8	19 河钢集 MTN002A	101900193	100,000	10,098,000.00
9	19 阳煤 MTN002	101900812	100,000	9,937,000.00
10	19 兖矿 MTN004	101901145	100,000	10,068,000.00
11	19 阳煤 MTN005	101901404	100,000	9,773,000.00
12	20 晋能 MTN001	102000011	100,000	9,931,000.00
13	20 庐江城投 MTN001	102000016	200,000	19,926,000.00
14	20 远东租赁 MTN001	102000137	100,000	9,950,000.00

15	20 苏沙钢 MTN003	102000248	100,000	9,821,000.00
16	20 阳煤 MTN002	102000410	100,000	9,687,000.00
17	20 潞安 MTN002	102000601	100,000	9,762,000.00
18	20 赣金控 MTN001	102000824	100,000	9,776,000.00
19	20 大连万达 MTN005	102002131	300,000	29,976,000.00

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。

五、备查文件

1、备查文件目录

(1)《融通通启一年定期开放债券型证券投资基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 26 日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告》

(2) 关于《融通通启一年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：中国农业银行股份有限公司

2020 年 12 月 15 日