

融通通启一年定期开放债券型证券投资基金  
第二次清算报告

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：二〇二一年三月一日

公告日期：二〇二一年三月五日

## 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日发布了《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。

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于2020年11月27日成立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，上海通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

本基金第一次清算期间为2020年11月27日至2020年12月14日。本基金的基金管理人于2020年12月18日对《融通通启一年定期开放债券型证券投资基金清算报告》进行了公告，并于2020年12月22日支付了第一次清算款。

本次清算为本基金的第二次清算，清算期间为2020年12月15日至2021年2月23日。

## 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	
第二次清算结束日（2021年2月23日）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
第二次清算结束日（2021年2月23日）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

第二次清算结束日资产负债表（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：2021年2月23日（第二次清算结束日）

单位：人民币元

资产	2021年2月23日（第二次清算结束日）
<b>资产：</b>	
银行存款	210,180,333.53
结算备付金	-
存出保证金	30,105.46
交易性金融资产	9,749,000.00
其中：债券投资	9,749,000.00
资产支持证券投资	-
应收利息	511,360.95
应收证券清算款	-
应收申购款	-
<b>资产总计</b>	<b>220,470,799.94</b>

<b>负债和所有者权益</b>	-
<b>负债：</b>	
卖出回购金融资产款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	-
应付托管费	-
应付销售服务费	-
应付交易费用	1,300.00
应付税费	4,862.22
应付利息	-
其他负债	120,000.00
<b>负债合计</b>	<b>126,162.22</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	541,063,346.26
未分配利润	-320,718,708.54
<b>所有者权益合计</b>	<b>220,344,637.72</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>220,470,799.94</b>

#### 四、清算情况

自 2020 年 12 月 15 日至 2021 年 2 月 23 日止为本基金第二次清算报告期，基金财产清算小组按照法律法规及《基金合同》的规定履行基金财产清算程序，对本基金的资产、负债进行清算，具体清算情况如下：

截至本次清算期结束日（2021 年 2 月 23 日）各项资产、负债清算情况如下：

##### 1、资产处置情况

（1）本基金第一次清算结束日所持有的金融资产已部分变现完成，截至 2021 年 2 月 23 日（第二次清算结束日）所持金融资产为人民币 9,749,000.00 元，明细如下：

证券名称	证券代码	数量（张）	第二次清算结束日估值金额（元）
20 阳煤 MTN002	102000410	100,000.00	9,749,000.00

（2）本基金第二次清算结束日的银行存款余额为人民币 210,180,333.53 元，该部分款项由基金托管人负责保管。

（3）本基金第二次清算结束日存出保证金为人民币 30,105.46 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）本基金第二次清算结束日应收利息人民币 511,360.95 元。

##### 2、负债清偿情况

（1）本基金第二次清算结束日应付交易费用为人民币 1,300.00 元，该款项将于费用缴

付日划出。

(2) 本基金第二次清算结束日应付税费为人民币 4,862.22 元, 该款项将于费用缴付日划出。

(3) 本基金第二次清算结束日其他负债为人民币 120,000.00 元, 该款项为预提信息披露费。

### 3、清算期间的剩余资产分配情况

项目	金额 (元)
一、第一次清算结束日 (2020-12-14) 基金净资产	557,278,640.79
加: 第二次清算期间 (2020-12-15 至 2021-2-23) 收入	-6,925,125.03
存款利息收入	249,885.23
债券利息收入	951,487.92
债券投资收益	-12,044,502.36
公允价值变动损益	3,917,712.51
其他收入	291.67
减: 第二次清算期间 (2020-12-15 至 2021-2-23) 费用	8,878.04
交易费用	2,557.98
税费	3,425.52
债券账户维护费	1,963.5
银行费用	931.04
二、第一次清算支付金额	330,000,000.00
三、第二次清算结束日 2021 年 2 月 23 日基金净资产	220,344,637.72
四、第二次清算支付金额	208,000,000.00

注: 根据本基金的基金合同约定, 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。由于本基金截至第二次清算期结束日 (2021 年 2 月 23 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。

### 4、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 11 月 27 日（基金最后运作日次日）至 2021 年 2 月 23 日（基金第二次清算结束日）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第二次清算报告》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

2021 年 3 月 1 日