
融通通启一年定期开放债券型证券投资基金
第三次清算报告

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：二〇二一年四月二十日

公告日期：二〇二一年四月二十三日

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，截至本基金开放期最后一日（即2020年11月26日）日终，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，本基金第一次清算、第二次清算已经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。

本基金首次清算期间为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。

本基金第二次清算期间为2020年12月15日至2021年2月23日。本基金的基金管理人于2021年3月5日对《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》进行了公告，并于2021年3月9日支付了第二次清算款。

本次清算为本基金的第三次清算，清算期间为 2021 年 2 月 24 日至 2021 年 4 月 13 日。清算报告已经基金托管人复核，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对第三次清算进行审计，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 | |
| 第三次清算结束日（2021 年 4 月 13 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 |
| 第三次清算结束日（2021 年 4 月 13 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

第三次清算结束日资产负债表（已经审计）

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 4 月 13 日（第三次清算结束日）

单位：人民币元

| | |
|------------|----------------------------------|
| 资产 | 2021 年 4 月 13 日（第三次清算结束日） |
| 资产： | |

| | |
|-------------------|---------------------|
| 银行存款 | 9,939,376.73 |
| 结算备付金 | - |
| 存出保证金 | 29,286.07 |
| 交易性金融资产 | - |
| 其中：债券投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |
| 应收利息 | 1,534.12 |
| 应收证券清算款 | - |
| 应收申购款 | - |
| 资产总计 | 9,970,196.92 |
| 负债和所有者权益 | - |
| 负债： | |
| 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 | 1,475.00 |
| 应付税费 | 350.92 |
| 应付利息 | - |
| 其他负债 | 16,400.00 |
| 负债合计 | 18,225.92 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 541,063,346.26 |
| 未分配利润 | -531,111,375.26 |
| 所有者权益合计 | 9,951,971.00 |
| 负债和所有者权益总计 | 9,970,196.92 |

四、清算情况

本次清算为本基金第三次清算，清算期间为2021年2月24日至2021年4月13日。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) 本基金第三次清算结束日的银行存款余额为人民币9,939,376.73元，该部分款项由基金托管人负责保管。

(2) 本基金第三次清算结束日出保证金为人民币 29,286.07 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) 本基金第三次清算结束日应收利息人民币 1,534.12 元。

3、负债清偿情况

(1) 本基金第三次清算结束日应付交易费用为人民币 1,475.00 元, 该款项将于费用缴付日划出。

(2) 本基金第三次清算结束日应付税费为人民币 350.92 元, 该款项将于费用缴付日划出。

(3) 本基金第三次清算结束日其他应付款为人民币 6,400.00 元, 该款项为应付上清账户维护费。

(4) 本基金第三次清算结束日应付律师费为人民币 10,000 元, 该款项将于费用缴付日划出。

4、清算期间的剩余资产分配情况

| 项目 | 金额(元) |
|-------------------------------------|----------------|
| 第二次清算结束日 2021 年 2 月 23 日基金净资产 | 220,344,637.72 |
| 加: 第三次清算期间(2021-2-24 至 2021-4-13)收入 | |
| 存款利息收入 | 56,753.60 |
| 债券利息收入 | 121,193.24 |
| 债券投资收益 | -3,085,943.56 |
| 公允价值变动损益 | 412,546.30 |
| 减: 第三次清算期间(2021-2-24 至 2021-4-13)费用 | |
| 交易费用 | 175.00 |
| 税费 | 436.30 |
| 债券账户维护费 | 6,400.00 |
| 银行费用 | 205.00 |
| 信息披露费 | -120,000.00 |
| 律师费 | 10,000.00 |
| 二、第二次清算支付金额 | 208,000,000.00 |
| 三、第三次清算结束日 2021 年 4 月 13 日基金净资产 | 9,951,971.00 |

注: 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。

2021 年 4 月 13 日至最后一次清算款划出日前一日的银行存款孳生的利息归基金份额持有人所有, 以上利息均按实际适用的利率计算。

上述应收利息及保证金款项待实际划付清算款时，由基金管理人融通基金管理有限公司以自有资金先行垫付，供清盘分配使用，待回款后再返还给基金管理人。

5、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 2021 年 2 月 24 日（基金第二次清算结束日次日）至 2021 年 4 月 13 日（基金第三次清算结束日）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三次清算报告》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 4 月 20 日