

# 建信恒丰纯债债券型证券投资基金清算报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

公告日期:2017年10月19日

## 一、重要提示

建信恒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[2016]1870号《关于准予建信恒丰纯债债券型证券投资基金注册的批复》注册,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信恒丰纯债债券型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。依据《建信恒丰纯债债券型证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)约定,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形,基金管理人应当终止本基金合同,并对本基金进行变现及清算程序,而无需召开基金份额持有人大会。截至2017年8月3日,本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元。为维护基金份额持有人利益,根据基金合同约定,本基金满足基金合同终止条件,于2017年8月4日进入财产清算程序。

本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见刊登在2017年8月4日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站(<http://www.ccbfund.cn>)上的《关于建信恒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》。

本基金清算期为18个工作日,自2017年8月4日至2017年8月29日止。由基金管理人建信基金管理有限责任公司、基金托管人兴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)和北京德恒律师事务所于2017年8月4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,北京德恒律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二、基金概况

1、基金名称:建信恒丰纯债债券型证券投资基金(基金简称:建信恒丰纯债债券,基金代码:003249)。

2、基金运作方式:契约型开放式

3、基金合同生效日:2016年11月15日

4、投资目标:在严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳健增值,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

5、投资策略:本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,动态调整大类金融资产比例,自上而下决定债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略,在严谨深入的分析基础上,综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,深入挖掘价值被低估的标的券种。

6、业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数。

7、风险收益特征:本基金为债券型基金,其风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

8、基金管理人:建信基金管理有限责任公司

9、基金托管人:兴业银行股份有限公司

## 三、财务会计报告

资产负债表(经审计)

会计主体:建信恒丰纯债债券型证券投资基金

报告截止日:2017年8月3日

单位:人民币元

资产 本期末

2017年8月3日

(基金最后运作日)

资产:

银行存款 97,905.83

应收利息 692.59

应收申购款 -

资产总计 98,598.42

负债和所有者权益

负债:

应付赎回款 -

应付管理人报酬 -

应付托管费 0.18

应付销售服务费 -

其他负债 75,495.14

负债合计 75,495.32

所有者权益:

实收基金 20,103.16

未分配利润 2,999.94

所有者权益合计 23,103.10

负债和所有者权益总计 98,598.42

注:

1.报告截止日 2017年8月3日(基金最后运作日), 基金份额净值 1.1492 元, 基金份额总额 20,103.16 份。

2.财务报表的实际编制期间为 2016年11月15日(基金合同生效日)至 2017年8月3日(基金最后运作日)。

#### 四、清盘事项说明

##### 1、基本情况

建信恒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[2016]第 1870 号《关于准予建信恒丰纯债债券型证券投资基金注册的批复》注册,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信恒丰纯债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。经向中国证监会备案,《建信恒丰纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2016年11月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,001,766.32 份。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信恒丰纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法上市的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产。本基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数。

根据《建信恒丰纯债债券型证券投资基金基金合同》以及建信基金管理有限责任公司于 2017年8月4日发布的《关于建信恒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》,自 2017年8月

4日起,本基金进入基金财产清算期,基金管理人已依据相关法律法规和本基金基金合同的规定,组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。

## 2、清算原因

当连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元,符合基金合同约定的基金合同终止条件。

根据基金合同规定基金合同终止,进入清算程序。

## 3、清算起始日

根据《关于建信恒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》,本基金清算起始日为 2017 年 8 月 4 日。

## 4、清算报表编制基础

本基金的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。自本基金最后运作日起,资产、负债均按清算价格计价。由于报告性质所致,本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

## 五、清算情况

自 2017 年 8 月 4 日至 2017 年 8 月 29 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,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《建信恒丰纯债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。考虑到本基金清算的实际情况,从保护基金份额持有人利益的角度出发,除银行直接扣付的划款手续费外,自清盘起始日起,与本基金的清算相关的清算费用将由基金管理人代为支付。

### 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日应收利息人民币 692.59 元,该款项由基金管理人建信基金管理有限责任公司以自有资金垫付,并已于 2017 年 8 月 23 日划入托管账户。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托管费为人民币 0.18 元,该款项已于 2017 年 8 月 8 日支付。

(2) 本基金最后运作日其他负债为人民币 75,495.14 元,为预提银行间账户维护费、信息披露费、预提审计费和预提银行划款手续费。预提银行间账户维护费 7,500.00 元已分别于 2017 年 8 月 4 日和 2017 年 8 月 21 日进行了支付。信息披露费 45,479.02 元已于 2017 年 8 月 14 日进行了支付。预提审计费用 22,500.00 元已于 2017 年 8 月 29 日进行了支付。预提银行划款手续费 16.12 元将于 2017 年 9 月 1 日进行支付。

### 4、清算日的清算损益情况

单位:人民币元

自 2017 年 8 月 4 日至

2017 年 8 月 29 日

止清算期间

项目

#### 一、清算收益

利息收入-银行存款利息收入(注 1) 76.48

清算收入小计 76.48

#### 二、清算费用

银行划款手续费(注 2) 23.88

清算费用小计 23.88

三、清算净收益 52.60

注 1：利息收入系计提的自 2017 年 8 月 4 日至 2017 年 8 月 29 日止清算期间的银行存款利息。

注 2：经本基金管理人建信基金管理有限责任公司确认，除银行直接扣付的划款手续费外，自清盘起始日起，与本次清算相关的清算费用由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。

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 2017 年 8 月 3 日基金净资产

23,103.10

加：清算期间净收益 52.60

二、2017 年 8 月 29 日基金资产净值 23,155.70

资产处置及负债清偿后，2017 年 8 月 29 日本基金剩余财产为人民币 23,155.70 元，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在清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金管理人建信基金管理有限责任公司以自有资金垫付并已于 2017 年 8 月 23 日划入托管账户人民币 769.07 元，用以垫付应收利息（包括本基金最后运作日应收利息人民币 692.59 元和清算期间利息收入 76.48 元），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。基金管理人垫付的资金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

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，报中国证监会备案后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）《建信恒丰纯债债券型证券投资基金清算审计报告》；

（2）《建信恒丰纯债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。

建信恒丰纯债债券型证券投资基金财产清算小组

2017 年 10 月 19 日