

海富通双利债券型证券投资基金清算报告

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日期：二〇一七年八月二十五日

清算报告公告日期：二〇一七年十月二十日

1 重要提示

海富通双利债券型证券投资基金(以下简称本基金)是由海富通双利分级债券型证券投资基金(以下简称原基金)转型而来,原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]第 1084 号《关于核准海富通双利分级债券型证券投资基金募集的批复》核准募集。基金管理人为海富通基金管理有限公司(以下简称基金管理人),基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称基金托管人)。原基金为契约型证券投资基金,以运作周年滚动的方式运作。《海富通双利分级债券型证券投资基金基金合同》(以下简称基金合同或《基金合同》)于 2013 年 12 月 4 日正式生效。由于原基金在第二个运作周年到期日前第 30 日,即 2015 年 11 月 4 日,基金资产净值低于 2 亿元,因此根据《基金合同》规定,原基金在第二个运作周年届满后转换为海富通双利债券型证券投资基金。双利 A 份额和双利 B 份额以 2015 年 12 月 4 日为转换基准日,全部转换为海富通双利债券型证券投资基金(基金简称:海富通双利债券,基金代码:519055)基金份额。

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》、《基金合同》的有关规定,鉴于本基金出现了基金合同终止事由,为维护基金份额持有人利益,根据基金合同约定,基金管理人与基金托管人协商一致后,不需召开基金份额持有人大会,决定终止本基金基金合同并依法履行基金财产清算程序。基金管理人已就该事项于 2017 年 8 月 1 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站刊登了《关于海富通双利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》。本基金的最后运作日定为 2017 年 8 月 4 日,并于 2017 年 8 月 5 日进入清盘期。

基金管理人、基金托管人、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 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。

2 基金产品概况

基金名称 海富通双利债券型证券投资基金(由海富通双利分级债券型证券投资基金转型而来)

基金简称 海富通双利债券

基金主代码 519055

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2013 年 12 月 4 日

基金最后运作日(2017 年 8 月 4 日)基金份额总额 6,159,162.79 份

投资目标 本基金在追求基金资产长期稳定增值的基础上,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。

投资策略 本基金的投资策略包括资产配置策略、债券投资组合策略、信用类债券投资策略、中小企业私募债投资策略、杠杆策略、可转换债券投资策略、新股申购策略。

业绩比较基准 中证全债指数

风险收益特征 本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人 海富通基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

3 基金运作情况概述

本基金由海富通双利分级债券型证券投资基金转型而来,原基金经中国证监会证监许可[2013]第 1084 号《关于核准海富通双利分级债券型证券投资基金募集的批复》核准募集。原基金为契约型证券投资基金,

以运作周年滚动的方式运作，基金份额划分为双利 A（基金份额简称：双利 A，基金代码：519052）与双利 B（基金份额简称：双利 B，基金代码：519053）两级份额，双利 A 自基金合同生效日起每满 6 个月开放申购和赎回一次，双利 B 在任一运作周年内封闭运作，不上市交易，仅在每个运作周年到期日开放申购和赎回一次。《海富通双利分级债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 4 日正式生效，共募集 1,025,386,372.71 份基金份额。由于原基金在第二个运作周年到期日前第 30 日，即 2015 年 11 月 4 日，基金资产净值低于 2 亿元，因此根据《基金合同》规定，原基金在第二个运作周年届满后转换为海富通双利债券型证券投资基金。投资者认购或申购且未赎回的每一份双利 A 和双利 B 基金份额，在基金份额转换基准日(即 2015 年 12 月 4 日)日终,基金管理人将按照基金合同所约定的运作周年内资产及收益的分配规定分别计算基金份额净值、双利 A 和双利 B 的份额净值，双利 A 和双利 B 份额按各自份额净值与基金份额净值之比为基准转换为海富通双利债券型证券投资基金(基金简称：海富通双利债券，基金代码：519055)的份额。截至 2017 年 8 月 4 日，本基金按基金合同正常运作。

依据《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《基金合同》的有关规定，本基金已出现连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元触发基金合同终止情形，此事项不需召开基金份额持有人大会。为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，基金管理人与基金托管人协商一致后，决定终止本基金基金合同。本基金最后运作日为 2017 年 8 月 4 日，清算期间为 2017 年 8 月 5 日至 2017 年 8 月 25 日。

4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：海富通双利债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 8 月 4 日

单位：人民币元

资产 基金最后运作日

2017 年 08 月 04 日

资产：

银行存款 5,836,145.91

结算备付金 15,238.47

存出保证金 3,008.64

应收利息 528.00

资产总计 5,854,921.02

负债和所有者权益 基金最后运作日

2017 年 08 月 04 日

负债：

应付赎回款 51,085.45

应付管理人报酬 543.43

应付托管费 155.27

其他负债 170,000.00

负债合计 221,784.15

所有者权益：

实收基金 5,399,863.99

未分配利润 233,272.88

所有者权益合计 5,633,136.87

负债和所有者权益总计 5,854,921.02

注：截止本基金最后运作日 2017 年 8 月 4 日，基金份额净值 0.915 元，基金份额总额 6,159,162.79 份。

4.2 利润表

会计主体：海富通双利债券型证券投资基金

报告期间：2017年1月1日至2017年8月4日(基金最后运作日)

项目 本期

2017年1月1日至2017年8月4日(基金最后运作日)

一、收入 166,919.39

利息收入 232,881.28

其中：存款利息收入 16,011.29

债券利息收入 157,137.53

买入返售金融资产收入 59,732.46

投资收益(损失以-填列) -95,856.60

其中：债券投资收益 -95,856.60

公允价值变动收益(损失以-号填列) 7,873.79

其他收入(损失以-号填列) 22,020.92

减：二、费用 277,027.05

管理人报酬 57,394.89

托管费 16,398.51

交易费用 92.67

利息支出 3,254.00

其中：卖出回购金融资产支出 3,254.00

其他费用 199,886.98

三、利润总额(亏损总额以-号填列) -110,107.66

减：所得税费用

四、净利润(净亏损以-号填列) -110,107.66

注：本财务报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师陈玲、都晓燕签字出具了普华永道中天特审字(2017)第 2188 号标准无保留意见的审计报告。

5 基金财产分配

本基金自 2017 年 8 月 5 日起进入清算程序，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：

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日结算备付金金额 15,238.47 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金。该款项由基金管理人以自有资金垫付，于 2017 年 8 月 22 日划入托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金金额 3,008.64 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算保证金。该款项由基金管理人以自有资金垫付，于 2017 年 8 月 22 日划入托管账户。

5.1.3 本基金最后运作日应收利息为 528.00 元。其中应收活期银行存款利息为 433.51 元，应收结算备付金利息为 62.91 元，应收保证金利息金额为 31.58 元，上述款项由基金管理人以自有资金垫付，已于 2017 年 8 月 22 日划入托管账户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款 51,085.45 元，该款项于 2017 年 8 月 7 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬 543.43 元，该款项于 2017 年 8 月 22 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费 155.27 元，该款项于 2017 年 8 月 22 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日其他负债 170,000.00 元，其中包括：

5.2.4.1 应付审计费 30,000.00 元，已按合同规定支付。

5.2.4.2 应付信息披露费 140,000.00 元，已按合同规定支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目 自 2017 年 08 月 05 日至 2017 年 08 月 25 日（清算期截止日）止

一、清算收益

1、利息收入（注 1） 2,440.04

清算收入小计 2,440.04

二、清算净收益 2,440.04

注 1：利息收入金额 2,440.04 元，系以当前适用利率计提的自 2017 年 8 月 5 日至 2017 年 8 月 25 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息。

5.4 清算费用

按照本基金合同第二十二基金合同的变更、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。

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，本基金最后运作日后产生的律师费、账户维护费、银行汇划费等清算费用将由基金管理人代为承担。

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产情况

项目 金额

一、基金最后运作日 2017 年 8 月 4 日基金净资产 5,633,136.87

加：清算期间净收益 2,440.04

加：清算期间基金份额交易产生的净值影响（注） -39,392.60

二、2017 年 8 月 25 日基金剩余资产净值 5,596,184.31

注：本基金最后运作日为 2017 年 8 月 4 日，最后运作日交易申请的确认日为 2017 年 8 月 7 日，确认赎回份额 43,052.02 份。

截至本次清算期结束日 2017 年 8 月 25 日，本基金剩余财产为人民币 5,596,184.31 元。自本次清算期结束日次日(2017 年 8 月 26 日)至本次清算款划出前一日的银行存款产生的利息（包括基金管理人垫付资金本金产生的利息）归基金份额持有人所有。

本基金所有剩余财产将按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5.6 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，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将根据法律法规及本基金的基金合同约定及时进行分析。

6 备查文件

6.1 备查文件目录

1、海富通双利债券型证券投资基金 2017 年 8 月 4 日（基金最后运作日）资产负债表及审计报告

2、《海富通双利债券型证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 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。

海富通双利债券型证券投资基金

基金财产清算小组

二〇一七年八月二十五日