

海富通可转债优选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：中国银行股份有限公司

清算报告出具日期：二〇二一年九月三十日

清算报告公告日期：二〇二一年十月二十八日

§1 重要提示

海富通可转债优选债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由海富通双福债券型证券投资基金转型而成。海富通双福债券型证券投资基金（原名海富通双福分级债券型证券投资基金）经中国证监会证监许可【2014】193号文准予注册，经中国证监会书面确认，《海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同》于2014年5月6日生效。2018年6月7日，基金管理人披露《海富通双福分级债券型证券投资基金分级份额终止运作后基金名称变更及海富通双福分级债券型证券投资基金份额转换结果的公告》，自此海富通双福分级债券型证券投资基金转换为海富通双福债券型证券投资基金。2019年6月4日起至2019年7月1日期间，海富通双福债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议通过了《关于变更注册海富通双福债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。自2019年7月4日起，《海富通可转债优选债券型证券投资基金基金合同》生效，《海富通双福债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。本基金的基金类型为契约型、开放式。

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》、《海富通可转债优选债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金基金管理人于2021年8月10日至2021年9月6日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于终止海富通可转债优选债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》（以下简称“本次大会议案”），并于2021年9月7日计票并表决通过了本次大会议案，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。基金管理人按照《基金合同》约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。本基金的最后运作日为9月8日，并于2021年9月9日进入清算期。

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2021年9月9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	海富通可转债优选债券型证券投资基金
基金简称	海富通可转债优选债券
基金主代码	519059
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年7月4日
基金最后运作日（2021年9月8日） 基金份额总额	1,747,002.17份
投资目标	本基金以可转换债券为主要投资对象，在严格控制风险的基础上，通过积极主动的管理，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金为债券型基金，对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，投资于可转换债券、可分离交易可转换债券的比例合计不低于非现金基金资产的80%。在此约束下，本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。由于可转换债券兼具债性和股性，本基金将着重对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究。对于可转换债券的投资将主要从三个方面的分析：数量为主的价值分析、债股性分析和公司基本面分析。通过以上分析，力求选择债券价值有一定支撑、安全性和流动性较好，并且发行人成长性良好的品种进行投资。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险及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。本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资品种。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 基金运作情况概述

本基金由海富通双福债券型证券投资基金转型而成。海富通双福债券型证券投资基金（原名海富通双福分级债券型证券投资基金）经中国证监会证监许可【2014】193号文准予注册，经中国证监会书面确认，《海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同》于2014年5月6日生效。2018年6月7日，基金管理人披露《海富通双福分级债券型证券投资基金分级份额终止运作后基金名称变更及海富通双福分级债券型证券投资基金份额转换结果的公告》，自此海富通双福分级债券型证券投资基金转换为海富通双福债券型证券投资基金。2019年6月4日起至2019年7月1日期间，海富通双福债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议通过了《关于变更注册海富通双福债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。自2019年7月4日起，《海富通可转债优选债券型证券投资基金基金合同》生效，《海富通双福债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。本基金为契约型、开放式证券投资基金，基金简称为海富通可转债优选债券（基金代码：519059）。

由于本基金规模持续处于小微基金状态，为保护投资人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）和《海富通可转债优选债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，我司经与基金托管人协商一致后，向中国证监会提出申请，于2021年8月10日至2021年9月6日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会，于2021年9月7日计票并表决通过了《关于终止海富通可转债优选债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

根据《基金合同》及相关公告规定，本基金的最后运作日确定为2021年9月8日，清算期间为2021年9月9日至2021年9月30日。

§4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：海富通可转债优选债券型证券投资基金

报告截止日：2021年09月08日

单位：人民币元

资 产	基金最后运作日 2021年09月08日
资 产：	
银行存款	273,468.14
结算备付金	3,363.40
存出保证金	182.04
应收证券清算款	1,197,995.12
应收利息	368.11
资产总计	1,475,376.81
负债和所有者权益	基金最后运作日 2021年09月08日
负 债：	
应付管理人报酬	250.57
应付托管费	71.59
应付税费	3.40
其他负债	29,300.00
负债合计	29,625.56
所有者权益：	
实收基金	1,224,406.60
未分配利润	221,344.65
所有者权益合计	1,445,751.25
负债和所有者权益总计	1,475,376.81

注：报告截止日2021年09月08日(基金最后运作日)，基金份额净值0.8276元，基金份额总额1,747,002.17份。

4.2利润表

会计主体：海富通可转债优选债券型证券投资基金

报告期间：2021年01月01日至2021年09月08日(基金最后运作日)

项目	本期
	2021年01月01日至2021年09月08日(基金最后运作日)
一、收入	37,582.19
利息收入	13,297.02
其中：存款利息收入	825.86
债券利息收入	12,319.66
投资收益(损失以“-”填列)	-91,645.02
其中：债券投资收益	-91,645.02
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	113,659.62
其他收入(损失以“-”号填列)	2,270.57
减：二、费用	72,989.61
管理人报酬	9,998.04
托管费	2,856.72
交易费用	776.50
利息支出	170.03
其中：卖出回购金融资产支出	170.03
税金及附加	11.38
其他费用	59,176.94
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-35,407.42
减：所得税费用	
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-35,407.42

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，注册会计师薛竞、沈兆杰签字出具了普华永道中天特审字(2021)第 3069 号标准无保留意见的审计报告。

§5 清算情况

自 2021 年 09 月 09 日至 2021 年 09 月 30 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：

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日结算备付金 3,363.40 元，存出保证金 182.04 元，分别为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和结算保证金。中国证券登记结算有限责任公司每月初第 2 个工作日对结算备付金、存出保证金进行调整，本基金已于 2021 年 10 月 11 日收回结算备付金 3,363.40 元、支付存出保证金 91.66 元。

5.1.2 本基金最后运作日应收证券清算款 1,197,995.12 元，为最后运作日卖出交易所债券应收清算款，已于 2021 年 9 月 9 日收回。

5.1.3 本基金最后运作日应收利息为 368.11 元。其中应收活期银行存款利息为 320.59 元，应收存出结算备付金利息为 46.62 元，应收存出保证金利息为 0.90 元。上述应收利息已于 2021 年 9 月 21 日结息时全部收回。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付管理人报酬 250.57 元，已于 2021 年 10 月 11 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费 71.59 元，已于 2021 年 10 月 11 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日其他负债 29,300.00 元，其中包括：

5.2.3.1 本基金最后运作日应付中央国债登记债券有限责任公司账户维护费 4,500.00 元，已于 2021 年 09 月 13 日支付。

5.2.3.2 本基金最后运作日应付银行间市场清算所股份有限公司账户维护费 4,500.00 元，已于 2021 年 09 月 13 日支付。

5.2.3.3 本基金最后运作日应付银行间市场清算所股份有限公司查询服务费 300.00 元，已于 2021 年 09 月 13 日支付。

5.2.3.4 应付截止 2021 年 09 月 08 日(基金最后运作日)清算审计费 20,000.00 元，将在收到会计师事务所审计费发票后支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付税费 3.40 元，已于 2021 年 10 月 14 日支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2021年09月09日至2021年09月30日（本次清算期截止日）止
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	305.28
清算收入小计	305.28
二、清算费用	
1、银行汇划手续费	15.00
清算费用小计	15.00
三、清算净收益	290.28

注：（1）利息收入金额 305.28 元，系以当前适用的利率计提的自 2021 年 09 月 09 日至 2021 年 09 月 30 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 资产处置及负债清偿后的剩余资产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2021年09月08日基金净资产	1,445,751.25
加：清算期间净收益	290.28
减：清算期间基金份额交易产生的净值影响（注）	-385.21
二、2021年09月30日基金剩余资产净值	1,445,656.32

注：本基金最后运作日为 2021 年 09 月 08 日，最后运作日交易申请的确认日为 2021 年 09 月 09 日。

截至本次清算期结束日 2021 年 09 月 30 日，本基金剩余财产 1,445,656.32 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，本基金剩

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。

2021年09月30日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将先行垫付应收银行存款利息，供清盘分配使用，待结息日回款后再返还给基金管理人；同时，为维护份额持有人的利益，2021年09月30日至清算款划出日前一日基金因清盘产生的相关费用亦由基金管理人承担。

5.5 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公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

§6 备查文件

6.1 备查文件目录

- 1、海富通可转债优选债券型证券投资基金清算财务报告及审计报告
- 2、关于《海富通可转债优选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。

海富通可转债优选债券型证券投资基金
基金财产清算小组
二〇二一年九月三十日