

融通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金
清算报告

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

编制日期：2022 年 6 月 21 日

公告日期：2022 年 6 月 22 日

一、重要提示

融通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2019 年 12 月 12 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于准予融通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]2810 号文）准予募集注册，基金合同生效日为 2020 年 5 月 22 日，基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《融通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，本基金将根据基金合同约定进入清算程序并终止，且无需召开基金份额持有人大会。

截至 2022 年 6 月 13 日日终，本基金资产净值出现连续 50 个工作日低于 5000 万元的情形，为保护投资者利益，基金管理人将按照基金合同约定程序对本基金进行清算并终止基金合同，且不需要召开基金份额持有人大会。

本基金管理人于 2022 年 6 月 14 日在《上海证券报》和基金管理人网站上刊登了《融通基金管理有限公司关于融通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金最后运作日为 2022 年 6 月 13 日，自 2022 年 6 月 14 日（最后运作日的次日）起，本基金进入清算程序，由基金管理人融通基金管理有限公司、基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司、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。

二、基金概况

基金名称	融通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金
基金简称	融通中债 1-3 年国开行债券指数
基金主代码	008787
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 22 日

基金管理人名称	融通基金管理有限公司	
基金托管人名称	上海浦东发展银行股份有限公司	
最后运作日（2022-6-13） 基金份额总额	53,762.68 份	
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，年跟踪误差控制在 2%以内。	
投资策略	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，对标的指数的久期等指标进行跟踪，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。为了在一定程度上弥补基金费用，基金管理人还可以在控制风险的前提下，使用其他投资策略。	
业绩比较基准	中债-1-3 年国开行债券指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，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。 本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
下属分级基金的基金简称	融通中债 1-3 年国开行债券指数 A	融通中债 1-3 年国开行债券指数 C
下属分级基金的交易代码	008787	008788
基金最后运作日 （2022-6-13） 基金份额总额	30,391.83	23,370.85

三、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：融通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 13 日

单位：人民币元

资产	2022 年 6 月 13 日(基金最后运作日)
银行存款	1,141,890.18
结算备付金	46.59
存出保证金	29.11
资产合计	1,141,965.88
负债	
应付赎回款	1,080,694.89

应付管理人报酬	108.47
应付托管费	36.12
应付销售服务费	66.13
其他负债	2,677.28
负债合计	1,083,582.89
所有者权益	
实收基金	53,762.68
未分配利润	4,620.31
所有者权益合计	58,382.99
负债与持有人权益总计	1,141,965.88

注：报告截止日 2022 年 6 月 13 日（基金最后运作日），基金份额总额为 53,762.68 份；其中融通中债 1-3 年国开行债券指数 A 基金份额总额为 30,391.83 份，基金份额净值 1.0970 元；融通中债 1-3 年国开行债券指数 C 基金份额总额为 23,370.85 份，基金份额净值 1.0715 元。

四、清算情况

自 2022 年 6 月 14 日至 2022 年 6 月 20 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，具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《融通中债 1-3 年国开行债券指数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）本基金最后运作日的银行存款余额为人民币 1,141,890.18 元（含银行存款应收利息人民币 1,856.56 元），该款项由基金托管人负责保管；

（2）本基金最后运作日结算备付金为人民币 46.59 元（均为结算备付金应收利息），该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司保管；

（3）本基金最后运作日存出保证金为人民币 29.11 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、负债清偿情况

（1）本基金最后运作日应付管理费为人民币 108.47 元，该款项于实际支付时扣除；

（2）本基金最后运作日应付托管费为人民币 36.12 元，该款项于实际支付时扣除；

(3)本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 66.13 元,该款项于实际支付时扣除;

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 2,677.28 元,其中:应付交易费用为人民币 630.00 元,应付审计费为人民币 1,000.00 元,应付指数使用费为人民币 947.28 元,应付汇划手续费 100.00 元,上述款项均于实际支付时扣除;

(5) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 1,080,694.89 元,该款项于约定支付日划出。

4、清算期间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 2022 年 6 月 13 日基金净资产	58,382.99
加:清算期间(2022 年 6 月 14 日至 2022 年 6 月 20 日)银行存款利息收入	2.97
减:清算期间(2022 年 6 月 14 日至 2022 年 6 月 20 日)基金赎回款	32,943.59
二、2022 年 6 月 20 日基金净资产	25,442.37

注:利息收入暂以当前适用利率预估计提自 2022 年 6 月 14 日至 2022 年 6 月 20 日止(假定清算款划付日期为 2022 年 6 月 21 日)清算期间的银行存款利息,若清算款实际划付日期变更,该金额也将相应调整。

资产处置及负债清偿后,截至 2022 年 6 月 20 日本基金剩余财产为人民币 25,442.37 元(假定清算款划付日期为 2022 年 6 月 21 日),若清算款实际划付日期变更,该金额也将相应调整。

为保护基金份额持有人利益,加快清算速度,清算款实际划付日由基金管理人以自有资金先行垫付上述应收款项,供清算分配使用,后续待应收款项回款后再返还基金管理人。

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,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) 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 13 日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告

(2) 关于《融通中债 1-3 年国开行债券指数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。

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

2022年6月21日