

海富通中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金 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：交通银行股份有限公司

清算报告出具日期：二〇二一年七月九日

清算报告公告日期：二〇二一年七月十九日

§1 重要提示

海富通中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金（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[2019]2207 号《关于准予海富通中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金注册的批复》注册募集。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”），基金托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。本基金的基金合同于 2020 年 8 月 3 日正式生效。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》、《海富通中债 3-5 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》”）的有关规定，本基金基金管理人于 2021 年 5 月 18 日至 2021 年 6 月 15 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于终止海富通中债 3-5 年国开行债券指数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 6 月 16 日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。基金管理人将按照《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 6 月 17 日，并于 2021 年 6 月 18 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 6 月 18 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	海富通中债3-5年国开行债券指数证券投资基金
基金简称	海富通中债3-5年国开债
基金主代码	008379

基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年8月3日	
基金最后运作日（2021年6月17日）基金份额总额	381,202.35份	
下属分级基金的基金简称	海富通中债3-5年国开债A	海富通中债3-5年国开债C
下属分级基金的交易代码	008380	008379
投资目标	本基金属于指数型基金，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准涨跌幅的日均跟踪偏离度控制在0.25%以内、年化跟踪误差控制在3%以内。	
投资策略	本基金为指数型基金，对指数投资部分将采用抽样复制标的指数投资方法，实现对中债-3-5 年国开行债券指数的紧密跟踪。如因基金的申购和赎回、标的指数编制规则调整等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响，或因某些特殊情况导致流动性不足，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金经理可以对投资组合进行适当变通和调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。主要投资策略包括：1、分层抽样策略；2、替代性策略；3、债券投资策略。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	

§3 基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可 [2019]2207 号《关于准予海富通中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金注册的批复》注册募集，为契约型、开放式证券投资基金，基金简称为海富通中债 3-5 年国开债 A（基金代码：008380），海富通

中债 3-5 年国开债 C（基金代码：008379）。《基金合同》于 2020 年 8 月 3 日正式生效，共募集 3,075,227,699.86 份基金份额。

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，《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 200 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 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召开基金份额持有人大会进行表决。基金管理人已就上述情形拟定了终止《基金合同》的解决方案，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 5 月 18 日至 2021 年 6 月 15 日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会，并于 2021 年 6 月 16 日表决通过了《关于终止海富通中债 3-5 年国开行债券指数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 6 月 17 日，清算期间为 2021 年 6 月 18 日至 2021 年 7 月 9 日。

§4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：海富通中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 06 月 17 日

单位：人民币元

资 产	基金最后运作日 2021年06月17日
资 产：	
银行存款	19,439.40
存出保证金	232.88
交易性金融资产	372,597.20
其中：债券投资	372,597.20

应收利息	12,200.18
资产总计	404,469.66
负债和所有者权益	基金最后运作日 2021年06月17日
负 债:	
应付赎回款	10.17
应付管理人报酬	28.87
应付托管费	9.61
应付销售服务费	0.61
应付交易费用	309.63
其他负债	15,161.51
负债合计	15,520.40
所有者权益:	
实收基金	381,202.35
未分配利润	7,746.91
所有者权益合计	388,949.26
负债和所有者权益总计	404,469.66

注：报告截止日2021年06月17日(基金最后运作日)，A类基金份额净值1.0203元，C类基金份额净值1.0199元。基金份额总额381,202.35份，其中A类基金份额370,190.20份，C类基金份额11,012.15份。

4.2利润表

会计主体：海富通中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金

报告期间：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 17 日(基金最后运作日)

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 17 日(基金最后运作日)
一、收入	-10,472.75
利息收入	148,116.95
其中：存款利息收入	4,012.04

债券利息收入	144,104.91
投资收益(损失以“-”填列)	340,593.99
其中：债券投资收益	340,593.99
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-504,194.49
其他收入(损失以“-”号填列)	5,010.80
减：二、费用	58,547.04
管理人报酬	6,654.55
托管费	2,218.19
销售服务费	7.38
交易费用	1,329.43
利息支出	11,487.41
其中：卖出回购金融资产支出	11,487.41
其他费用	36,850.08
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-69,019.79
减：所得税费用	
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-69,019.79

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 2810 号标准无保留意见的审计报告。

§5 清算情况

自 2021 年 06 月 18 日至 2021 年 07 月 09 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 本基金最后运作日存出保证金金额 232.88 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的交易所结算保证金。中国证券登记结算有限责任公司每月初

第 2 个工作日对存出保证金进行调整，本基金已于 2021 年 07 月 02 日全部收回存出保证金 232.88 元。

5.1.2 本基金最后运作日持有以下债券：

债券代码	债券名称	数量(张)	期末成本总额	期末估值总额
019640	20 国债 10	220	21,964.56	22,002.20
200212	20 国开 12	3,500	350,728.00	350,595.00
合计		3,720	372,692.56	372,597.20

截至 2021 年 07 月 09 日（本次清算期结束日），上述债券已全部卖出，卖出总金额 383,927.83 元，其中包含应收利息 11,295.30 元，卖出净价金额 372,632.53 元。

5.1.3 本基金最后运作日应收利息为 12,200.18 元。其中应收活期银行存款利息为 904.82 元，应收存出保证金利息金额为 1.35 元，应收债券利息 11,294.01 元。应收债券利息已于卖出债券时收回，应收活期银行存款利息 904.82 元、应收存出保证金利息 1.35 元于 2021 年 06 月 21 日结息时收回。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款 10.17 元，已于 2021 年 06 月 18 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬 28.87 元，已于 2021 年 07 月 02 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费 9.61 元，已于 2021 年 07 月 02 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费 0.61 元，已于 2021 年 07 月 02 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日应付交易费用为 309.63 元，已于 2021 年 06 月 25 日支付。

5.2.6 本基金最后运作日其他负债 15,161.51 元，其中包括：

5.2.6.1 本基金最后运作日应付指数使用费 161.51 元，已于 2021 年 07 月 02 日支付。

5.2.6.2 应付截止 2021 年 06 月 17 日(基金最后运作日)清算审计费 15,000.00 元，将在收到会计师事务所审计费发票后支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2021年06月18日至2021年07月09日（本次清算期截止日）止
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	167.53
2、债券变现损益（注2）	35.35
清算收入小计	202.88
二、清算费用	
1、交易费用（注3）	150.90
2、银行汇划手续费	50.00
清算费用小计	200.90
三、清算净收益	1.98

注：

（1）利息收入金额 167.53 元，系以当前适用的利率计提的自 2021 年 06 月 18 日至 2021 年 07 月 09 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息以及持有债券的利息收入。

（2）债券变现损益为本次清算期间债券资产卖出金额扣除截止变现日应收债券利息后，与最后运作日估值金额的差额。

（3）交易费用为本次清算期间债券资产变现所产生的交易费用。

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06月17日基金净资产	388,949.26
加：清算期间净收益	1.98
减：清算期间基金份额交易产生的净值影响（注）	-50.80

二、2021年07月09日基金剩余资产净值	388,900.44
-----------------------	------------

注：本基金最后运作日为 2021 年 06 月 17 日，最后运作日交易申请的确认日为 2021 年 06 月 18 日。

截至本次清算期结束日 2021 年 07 月 09 日，本基金剩余财产 388,900.44 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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2021 年 07 月 09 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该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），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 07 月 09 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、海富通中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金清算财务报告及审计报告
- 2、关于《海富通中债 3-5 年国开行债券指数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。

海富通中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金
基金财产清算小组

二〇二一年七月九日