

融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金
清算报告

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

编制日期：2022年7月22日

公告日期：2022年7月23日

一、重要提示

融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)是由融通增祥债券型证券投资基金变更注册而来。原融通增祥债券型证券投资基金经中国证监会《关于准予融通增祥债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]840号文)准予募集注册,根据《关于融通增祥债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,自2019年7月11日起,融通增祥债券型证券投资基金正式转型并更名为融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金。基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为江苏银行股份有限公司。

根据《融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)“第五部分 基金的存续”之“二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定:“本基金合同生效三年后的对应日,若本基金资产净值低于两亿元,本基金合同自动终止,且无需召开基金份额持有人大会审议,且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化,上述终止规定被取消、更改或补充时,本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。”

截至2022年7月11日(基金合同生效三年后的对应日)日终,本基金资产净值低于两亿元。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,且无需召开基金份额持有人大会审议,详见本基金管理人于2022年7月12日在《中国证券报》和基金管理人网站上刊登的《融通基金管理有限公司关于融通增祥三个月定期开放债券型发起式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7月11日。自2022年7月12日(最后运作日的次日)起进入清算期,清算期间为自2022年7月12日至2022年7月21日止。由基金管理人融通基金管理有限公司、基金托管人江苏银行股份有限公司、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)对清算报告进行审计,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 | 融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称 | 融通增祥三个月定开债券发起式 |

| | |
|-----------------------------|---|
| 基金主代码 | 002719 |
| 基金运作方式 | 契约型、定期开放式、发起式 |
| 基金合同生效日 | 2019年7月11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 | 江苏银行股份有限公司 |
| 最后运作日（2022-07-11） 基金份额总额 | 9,178,642.78份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金在封闭期与开放期采用不同的投资策略。本基金封闭期内的具体投资策略包括资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略、国债期货投资策略等部分。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价（总值）指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 |

三、基金运作情况

本基金基金合同自2019年7月11日起正式生效，2019年7月11日至2022年7月11日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

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》和《融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金出现了基金合同终止事由：

根据基金合同“第五部分 基金的存续”之“二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“本基金合同生效三年后的对应日，若本基金资产净值低于两亿元，本基金合同自动终止，且无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。”

截至2022年7月11日（基金合同生效三年后的对应日）日终，本基金资产净值低于两亿元。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，且无需召开基金份额持有人大会审议，详见本基金管理人于2022年7月12日发布的《融通基金管理有限公司关于融通增祥三个月定期开放债券型发起式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 7 月 11 日，从 2022 年 7 月 12 日起进入清算程序。

四、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：融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 7 月 11 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

| 资产 | 2022 年 7 月 11 日(基金最后运作日) |
|-------------------|--------------------------|
| 银行存款 | 196,759.24 |
| 结算备付金 | 1,732,974.67 |
| 存出保证金 | 60,741.75 |
| 交易性金融资产 | 11,582,159.43 |
| 资产合计 | 13,572,635.09 |
| 负债 | |
| 应付管理人报酬 | 17,853.63 |
| 应付托管费 | 4,463.42 |
| 应交税费 | 1,607.55 |
| 其他负债 | 122,963.48 |
| 负债合计 | 146,888.08 |
| 所有者权益 | |
| 实收基金 | 9,178,642.78 |
| 未分配利润 | 4,247,104.23 |
| 所有者权益合计 | 13,425,747.01 |
| 负债与持有人权益总计 | 13,572,635.09 |

注：报告截止日 2022 年 7 月 11 日（基金最后运作日），基金份额总额为 9,178,642.78 份，基金份额净值为 1.4627 元。

五、清算情况

自 2022 年 7 月 12 日至 2022 年 7 月 21 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《融通增祥三个月定期开放债券型发起式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剩余财产中支付。

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 196,759.24 元（含银行存款应收利息人民币 10,593.40 元），该款项由基金托管人负责保管；

(2) 本基金最后运作日备付金为人民币 1,732,974.67 元（含备付金应收利息人民币 1,967.37 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) 本基金最后运作日保证金为人民币 60,741.75 元（含备付金应收利息人民币 45.50 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；

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产全部为债券，债券市值为人民币 11,582,159.43 元，该金额为各只债券的最后运作日估值金额之和，本基金最后运作日（2022 年 7 月 11 日）持有的债券明细如下：

单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 |
|----|-----------|----------------|-----------|---------------|
| 1 | 019666 | 22 国债 01 | 60,000.00 | 6,071,136.99 |
| 2 | 210212 | 21 国开 12 | 51,000.00 | 5,193,860.96 |
| 3 | 102002017 | 20 中原豫资 MTN001 | 3,000.00 | 317,161.48 |
| 合计 | | | | 11,582,159.43 |

所列示的资产于清算期间（2022 年 7 月 12 日至 2022 年 7 月 21 日）进行处置变现。

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 17,853.63 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 4,463.42 元，该款项于实际支付时扣除；

(3) 本基金最后运作日应交税费为人民币 1,607.55 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 122,963.48 元，其中：

应付交易费用为人民币 27,563.48 元，该款项于实际支付时扣除；

应付审计费为人民币 23,000.00 元，该款项于实际支付时扣除；

应付信披费为人民币 60,000.00 元，该款项于实际支付时扣除

应付上清账户维护费为人民币 6,400.00 元，该款项于实际支付时扣除；

应付中债账户维护费为人民币 6,000.00 元，该款项于实际支付时扣除。

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 7 月 11 日基金净资产 | 13,425,747.01 |
| 加：清算期间（2022 年 7 月 12 日至 2022 年 7 月 21 日）收入 | |
| 利息收入-银行存款利息收入 | 1,849.44 |
| 利息收入-保证金利息收入 | 27.30 |
| 利息收入-备付金利息收入 | 779.00 |
| 利息收入-债券利息收入 | 947.56 |
| 差价收入-债券差价收入 | 9,083.76 |
| 加：清算期间公允价值变动（2022 年 7 月 12 日至 2022 年 7 月 21 日） | -9,990.01 |
| 减：清算期间（2022 年 7 月 12 日至 2022 年 7 月 21 日）费用 | |
| 交易费用 | 313.50 |
| 减：清算期间（2022 年 7 月 12 日至 2022 年 7 月 21 日）增值税 | 0.67 |
| 二、2022 年 7 月 21 日基金净资产 | 13,428,129.89 |

注：利息收入暂以当前适用利率预估计提自 2022 年 7 月 12 日至 2022 年 7 月 21 日止（假定清算款划付日期为 2022 年 7 月 22 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 7 月 21 日本基金剩余财产为人民币 13,428,129.89 元（假定清算款划付日期为 2022 年 7 月 22 日），若清算款实际划付日期变更，该金额也将相应调整。根据本基金基金合同约定，基金管理人将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。

为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，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，供清盘分配使用，待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，并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。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1)《融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 7 月 11 日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告》

(2) 关于《融通增祥三个月定期开放债券型发起式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：江苏银行股份有限公司

2022年7月22日