

中融融裕双利债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
清算报告出具日:2022年1月7日
清算报告公告日:2022年2月10日

一、重要提示及目录

1、重要提示

中融融裕双利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”或“中融融裕双利债券”)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[2016]938号文《关于准予中融融裕双利债券型证券投资基金注册的批复》注册,于2016年7月21日成立并正式运作,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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》”)、《中融融裕双利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”)的有关规定,中融基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)经与本基金的基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,由基金管理人召集,以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会,审议终止本基金基金合同相关事项的议案。本基金份额持有人大会已于2021年12月28日表决通过了《关于终止中融融裕双利债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,决定终止本基金基金合同。基金份额持有人大会的表决结果及决议生效的公告详见2021年12月29日刊登在《证券时报》和基金管理人网站(www.zrfunds.com.cn)上的《中融基金管理有限公司关于中融融裕双利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公告》。

本基金自2021年12月29日起进入清算程序。由基金管理人中融基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、上会会计师事务所(特殊普通合伙)、上海市海华永泰律师事务所于2021年12月29日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由上会会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海市海华永泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

2、目录

二、基金概况

- 基金名称:中融融裕双利债券型证券投资基金
 - 基金简称:中融融裕双利债券(基金代码:002785)、中融融裕双利债券A(基金代码:002785)、中融融裕双利债券C(基金代码:002786)
 - 基金运作方式:契约型开放式
 - 基金合同生效日:2016年7月21日
 - 2021年12月28日(基金最后运作日)基金份额总额:6,875,713.83份,其中:中融融裕双利债券A:5,767,526.42份
中融融裕双利债券C:1,108,187.41份
 - 投资目标:在注重资产安全性和流动性的前提下,积极主动调整投资组合,追求基金资产的长期稳定增值,并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。
 - 投资策略:(1)债券投资策略(2)股票投资策略(3)中小企业私募债券投资策略(4)资产支持证券投资策略(5)权证投资策略
 - 业绩比较基准:中债总指数(全价)收益率×80%+沪深300指数收益率×20%
 - 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混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。
 - 基金管理人:中融基金管理有限公司
 - 基金托管人:中国工商银行股份有限公司
- #### 三、财务会计报告
- 资产负债表(经审计)
会计主体:中融融裕双利债券型证券投资基金
报告截止日:2021年12月28日

单位:人民币元

项目	基金最后运作日2021年12月28日
资产:	
银行存款	43,622.28
结算备付金	183,990.71
存出保证金	1,583.92
交易性金融资产	5,922,592.20
其中:债券投资	5,922,592.20
买入返售金融资产	800,000.00
应收证券清算款	75.84
应收利息	134,906.80
应收申购款	298.09
资产合计	7,087,069.84
负债:	
应付赎回款	1,030.66
应付管理人报酬	4,551.40
应付托管费	1,137.87
应付销售服务费	354.71
其他负债	19,833.98
负债合计	26,908.62
所有者权益:	
实收基金	6,875,713.83
未分配利润	184,447.39
所有者权益合计	7,060,161.22
负债及所有者权益合计	7,087,069.84

四、清算事项说明

1、基本情况

中融融裕双利债券型证券投资基金(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[2016]938号文《关于准予中融融裕双利债券型证券投资基金注册的批复》注册,由中融基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融融裕双利债券型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)公开募集,于2016年7月21日募集成立。本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、可交换公司债券、中小企业私募债券、债券回购等)、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金业绩比较基准为:中债总指数(全价)收益率×80%+沪深300指数收益率×20%。

2、清算原因

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《中融融裕双利债券型证券投资基金基金合同》有关规定,基金管理人经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,提议终止《中融融裕双利债券型证券投资基金基金合同》。本基金管理人组织召开基金份额持有人大会,审议并通过了《关于终止中融融裕双利债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,并依法履行基金财产清算程序。

3.清算起始日

根据《基金合同》及《中融基金管理有限公司关于中融融裕双利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公告》，2021年12月28日为基金最后运作日，本基金于2021年12月29日进入清算期，故本基金清算起始日为2021年12月29日。

4.清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。本基金自最后运作日起，资产负债按实际清算价格计价。

五、清算情况

自2021年12月29日至2022年1月6日止为本基金清算期，中融融裕双利债券型证券投资基金自清算起始日起，中融融裕双利债券型证券投资基金基金财产清算小组成立，并对中融融裕双利债券型证券投资基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行，具体情况如下：

1.资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款43,622.28元，清算期间收到债券投资变现资产划入银行存款6,860,058.96元，收到结算备付金转入124,860.28元，收到存出保证金转入1,583.92元，收到申购款298.09元，收到证券清算款75.84元，支付赎回款1,030.66元，支付汇划费5.00元，清算结束日银行存款7,029,463.71元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金183,990.71元，清算期间划入银行存款124,860.28元，清算结束日结算备付金59,130.43元，预计将于2022年2月转入托管账户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金1,583.92元，清算期间1,583.92元已全部转入托管账户。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产5,922,592.20元，系基金持有的债券投资，已于清算期间全部变现。

(5) 本基金最后运作日买入返售金融资产800,000.00元，已于清算期间全部变现。

(6) 本基金最后运作日应收证券清算款75.84元，已于清算期间全部收回并划入托管账户。

(7) 本基金最后运作日应收银行存款利息3.36元、应收结算备付金利息66.24元、应收存出保证金利息0.56元、应收债券利息134,836.64元，共计134,906.80元（其中，应收债券利息134,836.64元已随债券变现全部转入托管账户）。清算期间计提债券利息收入1,182.78元，已随债券变现全部转入托管账户；计提买入返售金融资产利息收入74.30元，已随回购到期全部转入托管账户；银行存款利息收入127.40元、计提结算备付金利息收入63.28元、计提存出保证金利息收入0.49元。清算结束日应收银行存款利息130.76元、应收结算备付金利息129.52元、应收存出保证金利息1.05元。以上各项应收利息预计将于下一个季度结息日结回托管账户。

(8) 本基金最后运作日应收申购款298.09元，已于清算期内全部收回并划入托管账户。

2.负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为1,030.66元，该款项已于清算期间从托管账户划出。

(2) 本基金最后运作日、清算结束日应付管理人报酬均为4,551.40元，该款项将于清算完成后从托管账户划出。

(3) 本基金最后运作日、清算结束日应付托管费均为1,137.87元，该款项将于清算完成后从托管账户划出。

(4) 本基金最后运作日、清算结束日应付销售服务费均为354.71元，该款项将于清算完成后从托管账户划出。

(5) 本基金最后运作日、清算结束日其他负债均为19,833.98元，系应付审计费，该款项将于清算审计完成后从托管账户划出。

3.所有者权益情况

最后运作日基金净资产为7,060,161.22元，基金份额共6,875,713.83份，其中中融融裕双利债券A份额5,767,526.42份、中融融裕双利债券C份额1,108,187.41份；清算结束日本基金剩余财产为7,062,977.51元，基金份额共6,875,713.83份，其中中融融裕双利债券A份额5,767,526.42份、中融融裕双利债券C份额1,108,187.41份。

4.清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	清算期间发生额
一、清算期间收入	
1.利息收入(注1)	1,448.25
2.投资收益	-1,292.17
3.公允价值变动损益	2,671.28
清算期间收入小计	2,827.34
二、清算期间费用	
1.交易费用	6.05
2.其他费用(注2)	5.00
清算期间费用小计	11.05
三、清算期间净收益(清算期间净损失以“-”表示)	2,816.29

注1：利息收入包括本基金自清算起始日2021年12月29日至清算结束日2022年1月6日产生的银行存款利息收入127.40元、结算备付金利息收入63.28元、保证金利息收入0.49元和债券利息收入1,182.78元，买入返售金融资产利息74.30元，共计1,448.25元。

注2：其他费用为汇划费5.00元。

5.清算结束日的资产负债及剩余财产的分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2021年12月28日基金净资产	7,060,161.22
加：清算期间净收益	2,816.29
减：清算期间应回影响的金额	0
减：清算期间应回影响的金额	0
二、清算结束日2022年1月6日基金净资产	7,062,977.51

根据《基金合同》中关于基金财产清算的相关约定，基金财产清算小组将依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用（基金管理人代为支付的部分除外）、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。同时，《基金合同》“第七部分 基金合同当事人及权利义务”中“三、基金份额持有人”项下约定：“同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。”基金财产将按照上述分配原则进行分配。

本基金清算起始日2021年12月29日至基金财产清算划出日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金产生的利息亦属基金份额持有人所有。如前述利息在本基金财产分配划出日前尚未结清，则未结息部分将由基金管理人中融基金管理有限公司以自有资金垫付至托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有，基金管理人所垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于利息结清后返还给基金管理人，基金财产清偿完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

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，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，将报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。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。

六、备查文件目录

1.备查文件目录

(1)《中融融裕双利债券型证券投资基金审计报告》；
(2)《上海市海华永泰律师事务所关于〈中融融裕双利债券型证券投资基金清算报告〉之法律意见》。

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。