

华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 4 月 20 日

§1 重要提示

华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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]1292 号《关于准予华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》注册，于 2016 年 8 月 9 日成立并正式运作。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《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《华安聚利 18 个月定期开放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，截至 2021 年 3 月 31 日，本基金基金资产净值不足 2 亿元，触发基金合同约定的终止条件，基金管理人已于 2021 年 4 月 1 日发布《关于华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金触发基金合同终止情形的公告》。根据前述公告，本基金最后运作日为 2021 年 03 月 31 日，自 2021 年 4 月 1 日进入清算期。

基金管理人华安基金管理有限公司、基金托管人中国民生银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于 2021 年 4 月 1 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

§2 基金产品概况

基金简称	华安聚利 18 个月定开债	
基金主代码	002948	
交易代码	002948	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 8 月 9 日	
下属分级基金的基金简称	华安聚利 18 个月定开债 A	华安聚利 18 个月定开债 C
下属分级基金的交易代码	002948	002949

报告期末(2021 年 03 月 31 日) 下属分级基金的份额总额	6,758,858.37 份	2,249,018.10 份
投资目标	在合理控制风险的前提下，通过主动管理充分捕捉债券市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	<p>封闭期内策略：发挥基金管理人的研究优势，将规范的宏观研究、严谨的个券分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整大类资产配置比例，自上而下决定债券组合久期及债券类属配置；在严谨深入的基本面分析和信用分析基础上，综合考量各类券种的流动性、供求关系、风险及收益率水平等，自下而上地精选个券。</p> <p>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，减小基金净值的波动。</p>	
业绩比较基准	中债综合全价指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，其预期的风险及预期的收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	

§3 基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]1292 号文注册，由基金管

理人华安基金管理有限公司依照法律法规、《华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》等规定向社会公开发行募集，基金合同于 2016 年 8 月 9 日生效。基金合同生效日的基金总份额为 1,704,527,032.60 份基金份额。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《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《华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，截至 2021 年 3 月 31 日，本基金基金资产净值不足 2 亿元，触发基金合同约定的终止条件，基金管理人已于 2021 年 4 月 1 日发布《关于华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金触发基金合同终止情形的公告》。根据前述公告，本基金最后运作日为 2021 年 03 月 31 日，自 2021 年 4 月 1 日进入清算期。

§4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 03 月 31 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2021年03月31日
资 产：	
银行存款	7,904,730.04
结算备付金	2,224,668.19
存出保证金	18,049.19
应收利息	7,131.42
应收申购款	604,477.66
资产总计	10,759,056.50
负债和所有者权益	最后运作日 2021年03月31日
负 债：	
应付赎回款	683,942.89
应付管理人报酬	111,055.09

应付托管费	37,018.36
应付销售服务费	854.27
应付交易费用	18,244.75
应交税费	55,361.70
其他负债	71,629.10
负债合计	978,106.16
所有者权益：	
实收基金	9,007,876.47
未分配利润	773,073.87
所有者权益合计	9,780,950.34
负债和所有者权益总计	10,759,056.50

注 1：本清算报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。自基金最后运作日起，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

注 2：本财务报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师陈胜、张旭颖签字出具了安永华明（2021）专字第 60971571_B05 号标准无保留意见的审计报告。

§5 清算情况

自 2021 年 4 月 1 日起至 2021 年 4 月 8 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为人民币 2,224,668.19 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金。该结算备付金于清算期间

(2021 年 4 月 2 日) 调整为人民币 44,845.52 元。该款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付, 基金管理人垫付资金已于 2021 年 4 月 1 日划入托管账户, 垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金为人民币 18,049.19 元, 其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算保证金人民币 16,418.53 元, 该结算保证金于清算期间(2021 年 4 月 2 日) 调整为人民币 22,766.04 元; 存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算保证金人民币 1,630.66 元, 该结算保证金于清算期间(2021 年 4 月 2 日) 调整为人民币 1,409.20 元。上述款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付, 基金管理人垫付资金已于 2021 年 4 月 1 日划入托管账户, 垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

5.1.3 本基金最后运作日应收利息为人民币 7,131.42 元, 其中应收银行存款利息人民币 6,122.22 元, 应收结算备付金利息人民币 1,001.10 元, 应收结算保证金利息人民币 8.10 元。该款项将于 2021 年 4 月 8 日之后或下一个结息日划入托管账户。

5.1.4 本基金最后运作日应收申购款为人民币 604,477.66 元, 该款项已于 2021 年 4 月 1 日收到。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 683,942.89 元, 该款项已于 2021 年 4 月 1 日、2021 年 4 月 2 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 111,055.09 元, 应付托管费为人民币 37,018.36 元, 应付销售服务费为人民币 854.27 元, 以上款项均已于 2021 年 4 月 2 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 18,244.75 元,为应付银行间交易费用,该款项将于 2021 年 4 月 8 日之后支付。

5.2.4 本基金最后运作日应交税费为人民币 55,361.70 元,为应交增值税及附加税,该款项已于 2021 年 4 月 8 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日其他负债为人民币 71,629.10 元,其中计提 2020 年度财务报表审计费人民币 50,000.00 元,预提 2021 年度财务报表审计费人民币 12,329.10 元,预提上清所账户服务费人民币 4,800.00 元,预提中债账户维护费人民币 4,500.00 元。其中计提 2020 年度财务报表审计费人民币 50,000.00 元已于 2021 年 4 月 7 日支付,预提 2021 年度财务报表审计费将于本基金年度财务报表审计报告出具后支付,若因本基金终止运作未出具年度财务报表审计报告,冲回该项预提费用产生的收益将按基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人,剩余预提上清所账户服务费及预提中债账户维护费将于 2021 年 4 月 8 日之后支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自2021年04月01日至2021年04月08日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入(注)	1,814.29
清算收入小计	1,814.29
二、清算费用	
清算费用小计	-
三、清算净收益	1,814.29

注:利息收入系计提的自 2021 年 4 月 1 日至 2021 年 4 月 8 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和结算保证金利息。其中预提的银行存款利息、结算备付金利息和结算保证金利息由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付,并已于 2021 年 4 月 1 日划入托管账户。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。

5.4 资产处置及负债清偿后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2021年3月31日基金净资产	9,780,950.34
加：清算期间净收益	1,814.29
加：基金净申购转入金额 （于2021年4月1日确认的投资者申购转入申请）	1,195,581.40
减：基金净赎回转出金额 （于2021年4月1日确认的投资者赎回转出申请）	1,277,657.93
二、2021年4月8日基金净资产	9,700,688.10

根据本基金的基金合同及《关于华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金触发基金合同终止情形的公告》，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、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。

资产处置及负债清偿后，本基金截至 2021 年 4 月 8 日止的剩余财产净额为人民币 9,700,688.10 元。

截至 2021 年 4 月 8 日止，经本基金基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币 12,224,559.93 元，其中人民币 2,561,964.45 元系基金管理人代垫的结算备付金、结算保证金以及以当前适用的利率预估的银行存款利息、结算备付金利息和结算保证金利息。

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。

§6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 1、华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 2、关于《华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金清算报告》的法律

意见

6.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 (<http://www.huaan.com.cn>)、中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)，清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金
基金财产清算小组

二〇二一年四月八日（清算报告出具日）