

# 汇安裕兴 12 个月定期开放纯债债券型发起 式证券投资基金

## 清算报告

基金管理人：汇安基金管理有限责任公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二四年十二月二十三日

报告公告日期：二〇二四年十二月二十八日

## 目录

1、重要提示.....	1
2、基金概况.....	2
3、基金运作情况说明.....	3
4、财务报告.....	4
5、清算事项说明.....	5
6、备查文件目录.....	8

## 1、重要提示

汇安裕兴12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可[2021]2002号《关于准予汇安裕兴12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，基金合同于2021年10月12日正式生效。本基金的基金管理人为汇安基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为兴业银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《汇安裕兴12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）“第五部分基金备案”中“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》生效满三年后继续存续的，在任一开放期最后一个工作日日终（登记机构完成最后一个工作日申购、赎回业务申请的确认以后），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，基金管理人应当终止《基金合同》，无须召开基金份额持有人大会。”本基金最近一个开放期为2024年11月4日至2024年11月29日。截至本次开放期最后一个工作日日终（登记机构完成最后一个工作日申购、赎回业务申请的确认以后），本基金资产净值低于五千万元，已触发《基金合同》中约定的基金终止条款。为维护基金份额持有人的利益，根据《基金合同》有关约定，汇安基金管理有限责任公司应依据基金财产清算程序对本基金进行财产清算并终止基金合同，且无需召开基金份额持有人大会。

本基金最后运作日为2024年12月2日。本基金自2024年12月3日起进入清算期，清算期间为2024年12月3日至2024年12月23日止。由基金管理人、基金托管人、容诚会计师事务所（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，并由容诚会计师事务所（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。

## 2、基金概况

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇安裕兴12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
基金简称	汇安裕兴12个月定开纯债债券
基金主代码	012796
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年10月12日
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金最后运作日（2024年12月2日） 基金份额总额	200,000.00份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略包括封闭期投资策略和开放期投资策略，封闭期投资策略包括大类资产配置策略及债券组合管理策略，其中债券组合管理策略包括利率策略、类属配置策略、信用策略、相对价值策略、债券选择策略、资产支持证券等品种投资策略和国债期货投资策略。
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和混合型基金，高于货币市场基金。

### 3、基金运作情况说明

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2021]2002号《关于准予汇安裕兴12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》负责公开募集。本基金基金合同于2021年10月12日生效，基金合同生效日基金份额总额为3,009,999,000.00份。

根据《汇安基金管理有限责任公司关于汇安裕兴12个月定期开放纯债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2024年12月2日，自2024年12月3日起，本基金进入基金财产清算程序。

## 4、财务报告

### 基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：汇安裕兴12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年12月2日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	基金最后运作日 2024年12月2日
<b>资产：</b>	
银行存款	5,639,182.03
结算备付金	56.88
资产总计	5,639,238.91
<b>负债：</b>	
应付赎回款	5,139,637.92
应付管理人报酬	46,498.27
应付托管费	15,499.43
其他负债	223,349.98
负债合计	5,424,985.60
<b>净资产：</b>	
实收基金	200,000.00
未分配利润	14,253.31
净资产合计	214,253.31
负债和净资产总计	5,639,238.91

注1：报告截止日2024年12月2日（基金最后运作日），汇安裕兴12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金份额净值人民币1.0713元，基金份额200,000.00份，资产净值人民币214,253.31元。

注2：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》《资产管理产品相关会计处理规定》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。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。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）已对财务报表进行了审计并出具了无保留意见的审计报告。

## 5、清算事项说明

自2024年12月3日起至2024年12月23日止的清算期间，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 清算费用

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。按照《基金合同》的规定清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的清算律师费将由基金管理人代为支付。

### 5.2 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币5,639,182.03元，包含应计利息人民币64,319.49元。清算期间，银行存款共计提利息人民币65.80元。其中人民币64,378.98元已于季度结息日划入托管户。截至清算期结束日，应计银行存款利息余额为人民币6.24元，该款项将由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至托管账户，垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

(2) 本基金最后运作日深圳结算备付金应计利息为人民币56.88元，已于季度结息日划入托管户。

### 5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币5,139,637.92元，该款项已于清算期间支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币46,498.27元，该款项已于清算期间支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币15,499.43元，该款项已于清算期间支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币223,349.98元，其中预提信息披露费为110,164.32元，该款项已于清算期间支付；预提清盘审计费为82,622.40元，该款项已于清算期间支付；应付交易费用为21,213.26元，该款项已于清算期间

支付；预提银行间中债上清账户维护费为9,300.00元，该款项已于清算期间支付；预提汇划费为50.00元，该款项将于实际支付时扣除。

#### 5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2024年12月3日至2024年12月23日止清算期间
一、收益	
1、利息收入（注1）	65.69
收入小计（损失以“-”填列）	65.69
二、费用	
1、银行汇划费	137.79
费用小计	137.79
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	-72.10

注1：利息收入系清算期间产生的银行存款利息收入、结算备付金利息收入。

#### 5.5 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2024年12月2日基金净资产	214,253.31
加：自2024年12月3日至2024年12月23日止清算期间净收益（损失以“-”填列）	-72.10
二、清算结束日2024年12月23日基金净资产	214,181.21

截至本次清算结束日2024年12月23日，本基金剩余财产为人民币214,181.21元。根据《基金合同》约定，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、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。考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的清算律师费将由基金管理人代为支付。

自清算结束日次日（2024年12月24日）至清算款项支付日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金的利息归基金份额持有人所有。截至清算款支付日前一



日的银行存款、结算备付金、存出保证金的利息中仍未收到的部分由基金管理人以自有资金垫付，供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后收到相关款项时返还给基金管理人，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

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，报监管机构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》等规定及时行分配。

## 6、备查文件目录

### 6.1 备查文件目录

(1) 《汇安裕兴12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金清算审计报告》

(2) 关于《汇安裕兴12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金清算报告》的法律意见

### 6.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层

上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36层

### 6.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人汇安基金管理有限责任公司,客户服务中心电话010-56711690。

公司网站: <http://www.huianfund.cn>

汇安裕兴12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金财产

清算小组

二〇二四年十二月二十八日