

华宸未来稳健添盈债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：华宸未来基金管理有限公司

基金托管人：长城证券股份有限公司

报告出具日期：2025 年 3 月 13 日

报告送出日期：2025 年 3 月 17 日

一、重要提示

华宸未来稳健添盈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【2021】3757号文准予注册，《华宸未来稳健添盈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”）于2021年12月29日正式生效。本基金基金管理人为华宸未来基金管理有限公司，基金托管人为长城证券股份有限公司。

基于市场环境变化及基金运作情况，为更好地保护基金份额持有人利益，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》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和基金合同的有关规定，本基金的基金管理人经与基金托管人长城证券股份有限公司协商一致，提议终止《华宸未来稳健添盈债券型证券投资基金基金合同》，并召开基金份额持有人大会审议上述事项。根据本基金管理人2025年2月27日公告的《华宸未来稳健添盈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》（以下简称“《决议生效公告》”），本次基金份额持有人大会于2025年2月26日表决通过了《关于华宸未来稳健添盈债券型证券投资基金终止基金合同相关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据《决议生效公告》，本基金最后运作日为2025年2月27日，自2025年2月28日起进入清算期。

本基金清算期为2025年2月28日至2025年3月6日，由本基金管理人华宸未来基金管理有限公司、基金托管人长城证券股份有限公司、容诚会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市海华永泰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，上海市海华永泰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	华宸未来稳健添盈债券型证券投资基金
基金简称	华宸未来稳健添盈债券
基金主代码	014500
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年12月29日
2025年2月27日（最后运作日）日终基金份额总额	1,027,797.14份
投资目标	在严格控制投资组合风险和保持资金流动性的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，并通过积极主动的投资管理，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、大类资产配置策略。基金管理人将根据股市、债市等的相对风险收益预期，调整股票、债券和货币市场工具

	等资产的配置比例。2、债券投资策略。(1) 久期管理策略。(2) 期限结构配置策略。(3) 骑乘策略。(4) 息差策略。(5) 可转换债券及可交换债券投资策略。(6) 信用债投资策略。3、股票投资策略。本基金通过系统地分析中国证券市场的特点和运作规律,运用定性分析和定量分析相结合的方法,努力实现超越股票基准指数的回报。4、资产支持证券投资策略。本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。	
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	华宸未来基金管理有限公司	
基金托管人	长城证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宸未来稳健添盈债券 A	华宸未来稳健添盈债券 C
下属分级基金的交易代码	014500	014501
2025 年 2 月 27 日(最后运作日)日终下属分级基金的份额总额	155,221.04 份	872,576.10 份

三、基金运作情况概述

华宸未来稳健添盈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【2021】3757 号《关于准予华宸未来稳健添盈债券型证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人华宸未来基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于 2021 年 12 月 29 日正式生效,首次设立募集规模为 337,894,679.79 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为华宸未来基金管理有限公司,基金托管人为长城证券股份有限公司。

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。

基于市场环境变化及基金运作情况,为更好地保护基金份额持有人利益,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》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和基金合同的有关规定,本基金的基金管理人经与基金托管人长城证券股份有限公司协商一致,提议终止基金合同,并召开基金份额持有人大会审议上述事项。根据本基金管理人 2025 年 2 月 27 日公告的《华宸未来稳健添盈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》(以下简称“《决议生效公告》”),本次基金份额持有人大会于 2025 年 2 月 26 日表决通过了《关于华宸未来稳健添盈债券型证券投资基金终止基金合同相关事项的议案》,本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据《决议生效公告》,本基金最后运作日为 2025

年 2 月 27 日，自 2025 年 2 月 28 日起进入清算期。

四、 财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：华宸未来稳健添盈债券型证券投资基金

报告截止日：2025 年 2 月 27 日

单位：人民币元

	最后运作日 2025 年 2 月 27 日
资产：	
货币资金	1,018.87
结算备付金	17,744.34
交易性金融资产	808,047.84
买入返售金融资产	150,000.00
应收清算款	6,009.42
资产总计	982,820.47
负债：	
应付赎回款	5,956.36
应付管理人报酬	813.41
应付托管费	135.57
应付销售服务费	474.45
其他负债	5,173.51
应付清算款	95.71
负债合计	12,649.01
净资产：	
实收基金	1,027,797.14
未分配利润	-57,625.68
净资产合计	970,171.46
负债和净资产总计	982,820.47

注 1：截至最后运作日 2025 年 2 月 27 日，华宸未来稳健添盈债券 A 基金份额为 155,221.04 份，基金份额净值为人民币 0.9492 元，基金资产净值为人民币 147,335.49 元；华宸未来稳健添盈债券 C 基金份额为 872,576.10 份，基金份额净值为人民币 0.9430 元，基金资产净值为人民币 822,835.97 元。

注 2：本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《资产管理产品相关会计处理规定》等的有关规定编制的。基金管理人编制清算报表是为了呈报本基金全体基金份额持有人以及中国证监会使用。因此，清算报表不适用于其他用途。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。

五、 清算情况

本基金的资产、负债及于清算期间的具体清算情况如下：

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。本基金的清算费用由基金管理人承担。

2、资产处置情况

(1) 本基金于 2025 年 2 月 27 日（最后运作日）货币资金账面价值为人民币 1,018.87 元，截至 2025 年 3 月 6 日（清算结束日）货币资金账面价值为人民币 814,784.65 元。

(2) 本基金于 2025 年 2 月 27 日（最后运作日）结算备付金账面价值为人民币 17,744.34 元，截至 2025 年 3 月 6 日（清算结束日）结算备付金为人民币 17,745.53 元。

(3) 本基金于 2025 年 2 月 27 日（最后运作日）持有的交易性金融资产账面价值为人民币 808047.84 元，均为债券投资，截至 2025 年 3 月 6 日（清算结束日）已全部变现完毕。

(4) 本基金于 2025 年 2 月 27 日（最后运作日）持有的买入返售金融资产账面价值为人民币 150000.00 元，截至 2025 年 3 月 6 日（清算结束日）已全部变现完毕。

(5) 本基金于 2025 年 2 月 27 日（最后运作日）应收清算款账面价值为人民币 6,009.42 元，截至 2025 年 3 月 6 日（清算结束日）已全部清收完毕。

3、负债清偿情况

(1) 本基金于 2025 年 2 月 27 日（最后运作日）应付赎回款为人民币 5,956.36 元，该款项已于 2025 年 2 月 28 日支付完毕。

(2) 本基金于 2025 年 2 月 27 日（最后运作日）应付管理人报酬为人民币 813.41 元，该款项已于 2025 年 3 月 4 日支付完毕。

(3) 本基金于 2025 年 2 月 27 日（最后运作日）应付托管费为人民币 135.57 元，该款项已于 2025 年 3 月 4 日支付完毕。

(4) 本基金于 2025 年 2 月 27 日（最后运作日）应付销售服务费为人民币 474.45 元，该款项已于 2025 年 3 月 4 日支付完毕。

(5) 本基金于 2025 年 2 月 27 日（最后运作日）应付清算款账面价值为人民币 95.71 元，截至 2025 年 3 月 6 日（清算结束日）应付清算款账面价值为人民币 95.71 元。

(6) 本基金于 2025 年 2 月 27 日（最后运作日）其他负债为人民币 5,173.51 元，为预提审计费、应付交易费用。其中，应付交易费用人民币 173.51 元已于 2025 年 3 月 6 日支付；此外，审计费人民币 5,000.00 元已于 2025 年 3 月 4 日支付。

4、清算期间的清算损益情况及剩余财产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、2025年2月27日（最后运作日）基金净资产	970,171.46
加：清算期间收益（损失以“-”填列）：	
利息收入（注1）	171.54
投资收益（注2）	-2,463.86
公允价值变动损益（注3）	2,508.13
减：基金净赎回金额	177,952.80
二、2025年3月6日（清算结束日）基金净资产	792,434.47

注1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2025年2月28日（清算起始日）至2025年3月6日（清算结束日）止期间的货币资金利息、备付金利息及买入返售利息；

注2：投资收益主要包括自2025年2月28日（清算起始日）至2025年3月6日（清算结束日）止期间的债券投资收益以及交易所市场交易费用等；

注3：公允价值变动损益系自2025年2月28日（清算起始日）至2025年3月6日（清算结束日）止期间债券投资的估值增值及其终止确认时的公允价值变动损益转出；

资产处置及负债清偿后，于2025年3月6日（清算结束日）本基金剩余净资产为人民币792,434.47元。根据本基金的基金合同约定，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，按各类基金份额在基金合同终止时由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内基金份额持有人的基金份额比例进行分配。

清算结束日次日2025年3月7日至清算款划出前一日的银行存款、结算备付金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，基金管理人将在清算付款日以自有资金先行垫付备付金本金、股息红利税、备付金以及银行存款利息，供清盘分配使用，待实际资金到账后再返还基金管理人，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。

六、 备查文件

1、备查文件目录

（1）华宸未来稳健添盈债券型证券投资基金清算财务报表及审计报告

（2）上海市海华永泰律师事务所关于《华宸未来稳健添盈债券型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。

华宸未来稳健添盈债券型证券投资基金基金财产清算小组

2025年3月13日