

---

华富恒富 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：华富基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2023 年 1 月 12 日

清算报告公告日：2023 年 1 月 18 日

## 一、重要提示

华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由华富恒富分级债券型证券投资基金通过基金合同修订转型而来。华富恒富分级债券型证券投资基金遵照《中华人民共和国证券投资基金法》于 2013 年 12 月 12 日获中国证监会证监许可[2013]1593 号文准予募集注册，2014 年 3 月 19 日基金合同正式生效。在获取中国证券监督管理委员会《关于准予华富恒富分级债券型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2017]418 号），经基金份额持有人大会表决通过，自 2017 年 11 月 22 日起，由《华富恒富分级债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效。基金管理人为华富基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

本基金依据《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》及《华富恒富 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，以通讯方式召开了基金份额持有人大会（以下简称“本次基金份额持有人大会”），本次基金份额持有人大会投票表决起止时间为自 2022 年 11 月 18 日起至 2022 年 11 月 28 日 17:00 止。本次基金份额持有人大会通过的表决事项为基金管理人于 2022 年 10 月 25 日在规定媒介刊登的《华富基金管理有限公司关于以通讯方式召开华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》之附件《关于华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》。本基金的最后运作日为 2022 年 12 月 15 日，本基金从 2022 年 12 月 16 日起进入清算程序。

基金管理人、基金托管人、天健会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2022 年 12 月 16 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由天健会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，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	华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	华富恒富 18 个月定期开放债券	
基金主代码	000502	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 11 月 22 日	
最后运作日（2022 年 12 月 15 日）基金份额总额	8,548,783.42 份	
投资目标	在严格控制投资风险的基础上，追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。	
投资策略	<p>本基金以久期和流动性管理作为债券投资的核心，在动态避险的基础上，追求适度收益。</p> <p>1、资产配置策略：本基金投资组合中债券类、货币类等大类资产各自的长期均衡比重，依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金，其资产配置以债券为主，并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下，本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪，在一定的范围内对资产配置调整，以降低系统性风险对基金收益的影响。</p> <p>2、纯固定收益投资策略：主要基于华富宏观利率检测体系的观测指标和结果，通过久期控制、期限结构管理、类属资产选择实施组合战略管理，同时利用个券选择、跨市场套利、骑乘策略、息差策略等战术性策略提升组合的收益率水平。</p>	
业绩比较基准	中证全债指数	
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偏低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
各类别基金的基金简称	华富恒富 18 个月定期开放债券 A	华富恒富 18 个月定期开放债券 C

各类别基金的交易代码	000502	000501
最后运作日（2022 年 12 月 15 日）各类别基金的份额总额	1,714,094.53 份	6,834,688.89 份

### 三、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：华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 15 日

单位：人民币元

	最后运作日 2022 年 12 月 15 日
资产：	
银行存款	9,237,945.21
其中：银行存款利息	2,219.42
存出保证金	41,069.48
其中：存出保证金利息	161.96
资产总计	9,279,014.69
负债：	
应付赎回款	1,497.00
应付管理人报酬	3,511.12
应付托管费	585.19
应付销售服务费	1,295.86

应付交易费用	100.00
应付税费	6.42
其他负债	173,322.60
负债合计	180,318.19
所有者权益：	
实收基金	7,351,536.06
未分配利润	1,747,160.44
所有者权益合计	9,098,696.50
负债和所有者权益总计	9,279,014.69

注：1. 报告截止日 2022 年 12 月 15 日(基金最后运作日)，华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 1.0847 元，华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金 C 类基金份额净值人民币 1.0592 元，基金份额总额 8,548,783.42 份，其中，华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金 A 类基金份额 1,714,094.53 份；华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金 C 类基金份额 6,834,688.89 份。

2. 本财务报告已经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师樊冬、朱慧签字出具了天健审（2023）6-2 号标准无保留意见的审计报告。

## 四、清算情况

自 2022 年 12 月 16 日至 2022 年 12 月 26 日止为本基金清算期，基金财产清算小组按照法律法规及《基金合同》的规定履行基金财产清算程序，全部工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

### （一）清算费用

按本基金《基金合同》约定，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财产中支付。

### （二）最后运作日资产清算情况

#### 1、资产处置情况

截至 2022 年 12 月 26 日银行存款利息余额为人民币 521.64 元，应收存出保证金本金利息合计余额为人民币 40,918.56 元，基金管理人华富基金管理有限公司将根据变现情况以自有资金垫付并向基金份额持有人分配，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。

#### 2、负债清偿情况

本基金最后运作日应付赎回款已于 2022 年 12 月 19 日前全部支付。

本基金最后运作日应付管理人报酬、托管费、销售服务费、增值税及附加税、交易费用等费用将于本清算报告备案公告后支付。

本基金最后运作日其他负债为人民币 173,298.60 元，系已预提的应付审计费 63,670.96 元，预提信息披露费 109,151.64 元，预提汇划费 476.00 元。全部款项将于收到相应缴费通知或本清算报告备案公告后支付。

#### 3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币

项目	自 2022 年 12 月 16 日至 2022 年 12 月 26 日止清算期间
一、清算损益	
1、利息收入（注 1）	987.86
清算损益小计	987.86

二、清算支出	
清算支出小计	0.00
三、清算净损益	987.86

注 1：利息收入系计提的自 2022 年 12 月 16 日至 2022 年 12 月 26 日止清算期间的银行存款利息。该款项尚未结息的部分将于最后分配前由基金管理人根据结息情况以自有资金垫付，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。

#### 4、清算期间的剩余资产分配情况

单位：人民币

项目	金额
一、最后运作日（2022 年 12 月 15 日）基金净资产	9,098,696.50
加：清算期间净损益	987.86
减：1, 基金赎回款及赎回费（2022 年 12 月 16 日确认的投资者赎回转出申请，于 2022 年 12 月 20 日支付）	294,858.90
二、2022 年 12 月 26 日基金净资产	8,804,825.46

资产处置及负债清偿后，于 2022 年 12 月 26 日本基金剩余财产为人民币 8,804,825.46 元，根据本基金《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。

自 2022 年 12 月 26 日（本次清算结束之日）起至清算款划出日前一日期间银行存款产生的利息亦属全体基金份额持有人所有。但基金管理人以自有资金垫付的资金，垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

#### 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。

## 五、备查文件

### 1、备查文件目录



(1) 《华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金清算审计报告》

(2) 《上海市通力律师事务所关于〈华富恒富 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》

## 2、存放地点

基金管理人的办公场所：上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼

存放网址：<http://www.hffund.com>

## 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。

咨询电话：400-700-8001

华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

2023 年 1 月 12 日