

# 海富通添鑫收益债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

清算报告出具日期：二〇二四年八月十六日

清算报告公告日期：二〇二四年八月二十八日

## §1 重要提示

海富通添鑫收益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（2019）2355号文准予注册募集。基金管理人为海富通基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国民生银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。本基金的基金合同于2020年4月23日正式生效。基金类型为契约型、开放式。

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》、《海富通添鑫收益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，本基金基金管理人于2024年7月12日至2024年8月5日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于海富通添鑫收益债券型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》（以下简称“本次大会议案”），并于2024年8月6日表决通过了本次大会议案，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。基金管理人按照《基金合同》约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。本基金的最后运作日为8月6日，并于2024年8月7日进入清算期。

基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2024年8月7日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（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。

## §2 基金产品概况

基金名称	海富通添鑫收益债券型证券投资基金
基金简称	海富通添鑫收益债券
基金主代码	008610
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日	2020年4月23日	
基金最后运作日（2024年8月6日）基金份额总额	9,149,084.37份	
下属分级基金的基金简称	海富通添鑫收益债券A	海富通添鑫收益债券C
下属分级基金的交易代码	008611	008610
投资目标	在控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金主要投资策略包括：1、资产配置策略；2、债券类属资产配置；3、债券投资组合策略（包括利率策略、信用策略、收益率曲线策略、杠杆策略）；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券及可交换债券投资策略；6、股票投资策略；7、流通受限证券投资策略。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
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

本基金经中国证监会证监许可〔2019〕2355号文准予注册，为契约型、开放式证券投资基金，基金简称为海富通添鑫收益债券A（基金代码：008611），海富通添鑫收益债券C（基金代码：008610）。《基金合同》于2020年4月23日正式生效，共募集597,014,658.09份基金份额。

2022年起A股市场开始了震荡下行的行情，使得二级债基的业绩较此前出现了明显的下滑，对投资者的吸引力下降，且本基金规定了单笔申购最高金额不得超过1000万元，对本基金的营销工作，尤其是面向机构客户的营销工作带来了很大负面影响。由于本基金规模持续处于小微基金状态，为保护投资人利益，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《基金合同》的有关规定，我司经与基金托管人协商一致后，于2024年7月12日至2024年8月5日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会，并于2024年8月6日表决通过了《关于海富通添鑫收益债券型证券投资基金终止基金合同

有关事项的议案》。

根据《基金合同》及相关公告规定，本基金的最后运作日确定为 2024 年 8 月 6 日，清算期间为 2024 年 8 月 7 日至 2024 年 8 月 16 日。

## §4 财务报告

### 4.1 资产负债表

会计主体：海富通添鑫收益债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 8 月 6 日

单位：人民币元

资产	基金最后运作日 2024年8月6日
<b>资产：</b>	
货币资金	215,007.58
结算备付金	73,651.82
存出保证金	2,159.56
交易性金融资产	9,681,788.77
其中：股票投资	1,589,893.84
基金投资	-
债券投资	8,091,894.93
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	1,300,065.16
应收清算款	8,554,213.24
应收股利	-
应收申购款	99.92
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	19,826,986.05
<b>负债和净资产</b>	<b>基金最后运作日</b>

	2024年8月6日
<b>负债：</b>	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	6.20
应付赎回款	9,930,965.10
应付管理人报酬	2,465.33
应付托管费	528.29
应付销售服务费	901.63
应付投资顾问费	-
应交税费	110.98
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	24,465.33
负债合计	9,959,442.86
<b>净资产：</b>	
实收基金	9,149,084.37
未分配利润	718,458.82
净资产合计	9,867,543.19
负债和净资产总计	19,826,986.05

注：截止本基金最后运作日2024年8月6日，基金份额总额9,149,084.37份。其中海富通添鑫收益债券型证券投资基金A类基金份额总额6,105,342.37份，基金份额净值1.0846元；海富通添鑫收益债券型证券投资基金C类基金份额总额3,043,742.00份，基金份额净值1.0663元。

#### 4.2利润表

会计主体：海富通添鑫收益债券型证券投资基金

报告期间：2024年1月1日至2024年8月6日(基金最后运作日)

项目	本期 2024年1月1日至2024年8月 6日(基金最后运作日)
<b>一、营业总收入</b>	315,991.67
利息收入	6,810.79
其中：存款利息收入	2,320.62
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	4,490.17
其他利息收入	-
投资收益(损失以“-”填列)	283,659.35
其中：股票投资收益	-2,029.79
基金投资收益	-
债券投资收益	247,054.87
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	38,634.27
其他投资收益	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	25,491.63
汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
其他收入(损失以“-”号填列)	29.90
<b>减：二、营业总支出</b>	140,388.01
管理人报酬	52,643.19
其中：暂估管理人报酬(若有)	-
托管费	11,280.64
销售服务费	12,392.35
投资顾问费	-
利息支出	11,375.96
其中：卖出回购金融资产支出	11,375.96
信用减值损失	-
税金及附加	16.17
其他费用	52,679.70

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	175,603.66
减：所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	175,603.66
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	175,603.66

注：本财务报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师朱宏宇、胡莲莲签字出具了普华永道特审字(2024)第 5562 号标准无保留意见的审计报告。

## §5 清算情况

本基金自 2024 年 8 月 7 日起进入清算程序，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金额 73,651.82 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的上交所最低结算备付金为 72,546.19 元，应计利息为 147.61 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司的深交所最低结算备付金为 956.31 元，应计利息为 1.71 元。上述款项中上交所和深交所最低结算备付金将于 2024 年 9 月初全部划回托管账户，应计利息将于每季度最低备付金结息后划回托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金金额 2,159.56 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的上交所存出保证金为 1,764.50 元，应计利息为 3.80 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司的深交所存出保证金为 389.99 元，应计利息为 1.27 元。上述款项中上交所和深交所的保证金将于 2024 年 9 月初全部划回托管账户，应计利息将于每季度保证金结息后划回托管账户。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产为股票资产和债券资产，市值分别

为 1,589,893.84 元和 8,091,894.93 元。股票资产已于 2024 年 8 月 8 日至 2024 年 8 月 14 日全部变现，卖出成交金额 1,589,740.79 元，交易费用 1,590.01 元。债券资产已于 2024 年 8 月 7 日至 2024 年 8 月 8 日全部变现，卖出成交总额 8,091,723.48 元，交易费用 0.00 元。截至 2024 年 8 月 15 日，上述变现金额已全部划回托管账户。

5.1.4 本基金最后运作日买入返售金融资产为交易所逆回购余额 1,300,065.16 元，于 2024 年 8 月 7 日、2024 年 8 月 8 日先后到期，到期金额 1,300,170.34 元。截至 2024 年 8 月 9 日，到期金额已全部划回托管账户。

5.1.5 本基金最后运作日应收清算款金额 8,554,213.24 元，于 2024 年 8 月 7 日划回托管账户。

5.1.6 本基金最后运作日应收申购款金额 99.92 元，于 2024 年 8 月 7 日划入托管账户。

## 5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付清算款人民币 6.20 元，已于 2024 年 8 月 7 日支付完毕。

5.2.2 本基金最后运作日应付赎回款人民币 9,930,965.10 元，已于 2024 年 8 月 8 日支付完毕。

5.2.3 本基金最后运作日应付管理人报酬 2,465.33 元，已于 2024 年 8 月 15 日支付完毕。

5.2.4 本基金最后运作日应付托管费 528.29 元，已于 2024 年 8 月 15 日支付完毕。

5.2.5 本基金最后运作日的应付销售服务费人民币 901.63 元，已于 2024 年 8 月 15 日支付完毕。

5.2.6 本基金最后运作日的应交税费人民币 110.98 元，已分别于 2024 年 8 月 7 日、2024 年 8 月 15 日支付完毕。

5.2.7 本基金最后运作日其他负债 24,465.33 元，其中包括：

5.2.7.1 应付交易佣金人民币 313.90 元，已于 2024 年 8 月 15 日支付完毕。

5.2.7.2 应付中央国债登记结算有限责任公司账户维护费、银行间市场清算



所股份有限公司账户维护费、银行间市场清算所股份有限公司客户端查询费共计 6,200.00 元，已于 2024 年 8 月 13 日支付完毕。

5.2.7.3 应付审计费 17,951.43 元，已于 2024 年 8 月 15 日支付完毕。

### 5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自2024年8月7日至2024年8月16日（清算期截止日）止
<b>一、清算收益</b>	
1、利息收入（注1）	997.67
2、股票变现损益（注2）	-4,359.28
3、债券变现损益（注3）	-171.45
清算收入小计	-3,533.06
<b>二、清算费用</b>	
1、银行汇划手续费	458.62
2、税金及附加	0.38
清算费用小计	459.00
<b>三、清算净收益</b>	-3,992.06

注：（1）利息收入金额 997.67 元，系以当前适用利率计提的自 2024 年 8 月 7 日至 2024 年 8 月 16 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息及买入返售金融资产利息收入。

（2）股票变现损益为本次清算期间股票资产卖出金额与最后运作日股票资产市值的差额，包含了交易费用及卖出股票补缴红利税金额。

（3）债券变现损益为本次清算期间债券资产卖出总额与最后运作日债券资产市值的差额。

### 5.4 清算费用

按照本基金合同“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的约定，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剩余财产中支付。

本基金清算期间发生的上述银行汇划手续费 458.62 元，从基金财产中支付。

## 5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产情况

项目	金额
一、基金最后运作日 2024 年 8 月 6 日基金净资产	9,867,543.19
加：清算期间净收益	-3,992.06
加：清算期间基金份额交易产生的净值影响	-32,000.44
二、2024 年 8 月 16 日基金剩余资产净值	9,831,550.69

注：截至本次清算期结束日 2024 年 8 月 16 日，本基金剩余财产为人民币 9,831,550.69 元。上述财产将根据本基金《基金合同》约定，依据基金财产清算的分配方案，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

自 2024 年 8 月 16 日至清算款划出前一日银行存款、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。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将先行垫付尚未收回的最低备付金及其应计利息、存出保证金及其应计利息和应计银行存款利息供清盘分配使用，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。

## 5.6 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，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分配。

# §6 备查文件

## 6.1 备查文件目录

- 1、海富通添鑫收益债券型证券投资基金清算审计报告
- 2、关于《海富通添鑫收益债券型证券投资基金清算报告》的法律意见

## 6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 6.3 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。

海富通添鑫收益债券型证券投资基金  
基金财产清算小组

二〇二四年八月十六日