
华富国潮优选混合型发起式证券投资基金

清算报告

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年10月17日

清算报告公告日：2024年10月23日

一、重要提示

华富国潮优选混合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（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]1731号《关于准予华富国潮优选混合型发起式证券投资基金变更注册的批复》准予变更注册，于2021年9月23日成立并正式运作。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”），基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《华富国潮优选混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）“第五部分 基金备案”之“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：“基金合同生效日起三年后的对应日（若无对应日则顺延至下一日），若基金资产净值低于2亿元或者基金份额持有人数量不满200人，本基金合同将按其约定程序进行清算并终止，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。”

本基金《基金合同》生效日为2021年9月23日，基金合同生效日起三年后的对应日为2024年9月23日。截至2024年9月23日日终，本基金的基金资产净值低于2亿元，触发《基金合同》终止的情形，本基金将按照《基金合同》的约定程序履行基金财产清算程序并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会审议，即本基金的最后运作日为2024年9月23日。

本基金基金财产清算相关安排详见基金管理人于2024年9月24日发布的《关于华富国潮优选混合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》。

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》等法律法规的有关规定和《基金合同》的约定，由本基金的基金管理人、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2024年9月24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	华富国潮优选混合型发起式证券投资基金
基金简称	华富国潮优选混合发起式
基金主代码	010711
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年9月23日
最后运作日（2024年9月23日）基金份额总额	22,102,845.23份
投资目标	本基金主要投资国潮优选主题相关股票，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>资产配置策略方面，本基金综合考量经济长期发展趋势、宏观经济周期变动、相关政策导向、利率水平等并结合各类资产的风险收益特征和当前估值水平等因素，决定各类资产配置比例，并随着上述因素的变化而适时调整配置比例。本基金在基金合同约定的各类资产配置范围内，根据上述资产配置策略，进行各类资产配置。股票投资策略方面，国潮优选主题相关股票的界定：随着国内企业制造能力、研发能力、创新能力的提升，国产品牌全面崛起，呈现出明显的进口替代的趋势。本基金定义的“国潮优选”主题是指能提供引导和代表国产潮流的优秀产品和服务的相关上市公司，重点关注领域包括：纺织服装、食品饮料、农林牧渔、家电、化工、汽车、交通运输、家居及建材等行业、消费者服务（旅游及休闲、酒店及餐饮、教育、综合服务），医药、消费电子、计算机、通信、商贸零售、金融等行业。未来如果由于经济发展、技术进步或产业升级造成国潮优选主题的覆盖范围发生变动，基金管理人在履行适当程序后，可以对上述界定进行调整和修订。行业投资策略：本基金的行业配置首先选择符合以上对国潮优选定义的行业。此外本基金在构建组合过程中将对组合的行业构成进行权衡和持续优化，以保持组合的行业分散性和保证流动性，降低投资风险。个股投资策略：本基金将结合定量、定性分析，从所选行业中精选出符合以下要求的上市公司进行投资。1）定</p>

量分析方面：本基金定量的方法主要通过对公司成长性指标、财务指标和估值指标等方面的综合评估，以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。包括：成长性指标（收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等）、财务指标（毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率等）、估值指标（PE、PEG、PS等）。2）定性分析方面：本基金采用定性分析的方法，主要从品牌影响力、商业模式及公司治理方面进行综合评估考察，从而精选出以消费需求为导向，符合时代发展和国家政策支持方向的上市公司。①品牌影响力。优秀的品牌拥有诚信度、知名度、美誉度等，是给公司带来溢价、产生增值的一种无形资产。强大的品牌影响力使得公司拥有行业领军的市场份额和广阔的增长远景。本基金将考察客户对品牌的认可程度来判断其影响力。②商业模式。公司的商业模式一定程度上影响其在行业中的地位和发展潜力。本基金将从商业模式的独特性、可复制性、可持续性、赢利性等角度考察公司的商业模式是否符合行业发展的趋势、是否可以维持公司销售规模和盈利的持续性增长。③公司治理。本基金所选公司应具有良好的公司治理，对公司治理的考察，主要从公司治理结构是否合理、公司高管诚信记录是否良好、公司发展战略是否合理有效、公司的关联交易是否透明、是否存在变相占用上市公司资源的事项等方面进行综合分析。

港股通标的股票投资策略：本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将精选投资于国潮优选主题相关的港股通标的股票，并将基本面健康、业绩增长快、估值有优势的港股纳入本基金的股票投资组合。债券投资策略方面，本基金可投资的债券品种包括国债、金融债和企业债等。本基金将在研判利率期限结构变化的基础上做出最佳的资产配置及风险控制。在选择国债品种中，本基金侧重于对国债品种所蕴涵的利率风险、流动性风险的分析，根据利率预测模型构造最佳期限结构的国债组合；在选择金融债、企业债品种时，本基金重点分析债券的市场风险以及发行人的资信品质。因为可转换债券和可交换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，且具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转

	<p>换债券和可交换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。资产支持证券投资策略方面，本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。股指期货投资策略方面，本基金投资股指期货依据资产配置策略，根据风险管理原则，以套期保值为目的，择时对冲股票资产的系统性风险或对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等。本基金在基金合同约定的股指期货投资比例内，择时调整股指期货的投资比例。本基金优选与现货的资产尽可能匹配、期限尽可能匹配、流动性较好的股指期货合约。本基金力争精准测算股指期货套期保值的相关要素，力争实现最佳套期保值效果。</p>	
业绩比较基准	<p>中证内地消费主题指数收益率*65%+中证港股通消费主题指数收益率*10%+中证全债指数收益率*25%</p>	
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，预期收益和风险水平高于债券型基金、货币市场基金，但低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>	
基金管理人	<p>华富基金管理有限公司</p>	
基金托管人	<p>中国建设银行股份有限公司</p>	
下属分级基金的基金简称	<p>华富国潮优选混合发起式 A</p>	<p>华富国潮优选混合发起式 C</p>
下属分级基金的交易代码	<p>010711</p>	<p>019196</p>
最后运作日（2024年9月23日）下属分级基金的份额总额	<p>21,488,051.81 份</p>	<p>614,793.42 份</p>

三、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2021]1731号《关于准予华富国潮优选混合型发起式证券投资基金变更注册的批复》准予变更注册，由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定于2021年9月9日至2021年9月17日向社会公开募集。本基金《基金合同》于2021年9月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为33,465,650.69份，其中认购资金利息折合4,813.97份基金份额。

自2021年9月23日至2024年9月23日期间，本基金正常运作。

根据《华富国潮优选混合型发起式证券投资基金基金合同》以及基金管理人华富基金管理有限公司于2024年9月24日发布的《关于华富国潮优选混合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《基金合同》生效日为2021年9月23日，基金合同生效日起三年后的对应日为2024年9月23日。截至2024年9月23日日终，本基金的基金资产净值低于2亿元，触发《基金合同》终止的情形，本基金将按照《基金合同》的约定程序履行基金财产清算程序并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会审议。本基金的最后运作日为2024年9月23日，并于2024年9月24日起进入清算程序。

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：华富国潮优选混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年9月23日

单位：人民币元

	最后运作日 2024年9月23日
资产：	
银行存款	1,050,525.61
其中：银行存款利息	33.87
清算备付金	1,608.55
其中：清算备付金利息	19.84
存出保证金	4,167.86
其中：存出保证金利息	9.90
交易性股票投资	11,661,672.38
交易性债券投资	510,873.29
应收申购款	899.20
资产总计	13,229,746.89
负债：	

应付赎回款	48,455.66
应付赎回费	65.45
应付管理人报酬	10,754.51
应付托管费	1,792.42
应付销售服务费	144.11
应付交易费用	2,825.24
应付税费	1.34
应付审计费	21,885.99
应付证券清算款	0.72
负债合计	85,925.44
所有者权益：	
实收基金	22,102,845.23
未分配利润	-8,959,023.78
所有者权益合计	13,143,821.45
负债和所有者权益总计	13,229,746.89

注:1. 报告截止日 2024 年 9 月 23 日(基金最后运作日),华富国潮优选混合型发起式证券投资基金 A 类基金份额净值为人民币 0.5948 元,华富国潮优选混合型发起式证券投资基

金 C 类基金份额净值为人民币 0.5911 元，基金份额总额 22,102,845.23 份，其中，华富国潮优选混合型发起式证券投资基金 A 类基金份额 21,488,051.81 份；华富国潮优选混合型发起式证券投资基金 C 类基金份额 614,793.42 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、沈文伟签字出具了天健审（2024）6-323 号标准无保留意见的审计报告。

五、清算情况

自 2024 年 9 月 24 日至 2024 年 10 月 16 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

（1）截至 2024 年 10 月 16 日银行存款余额为 15,826,812.65 元，其中应收利息为 1,338.52 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）截至 2024 年 10 月 16 日清算备付金余额为 221.64 元，其中中登上海最低清算备付金应收利息为 0.96 元，中登深圳最低清算备付金应收利息为 0.72 元，深港通备付金应收利息为 219.96 元。以上备付金应计利息将于 2024 年第四季度银行结息日后结息入账。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。

（3）截至 2024 年 10 月 16 日存出保证金余额为 3,122.74 元，其中中登上海存出保证金为 1,431.20 元，中登上海存出保证金应收利息为 2.10 元，中登深圳存出保证金为 1,686.67 元，中登深圳存出保证金应收利息为 2.44 元，深港通存出保证金应收利息为 0.33 元。以上存出保证金将于清算期结束次月第二个交易日退回，存出保证金应计利息将于 2024 年第四季度银行结息日后结息入账。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。

（4）交易性股票投资已于 2024 年 10 月 10 日全部变现完毕，金额合计 14,471,565.00 元。

（5）交易性债券投资已于 2024 年 10 月 9 日全部变现，金额合计 511,228.90 元。

2、负债清偿情况

- (1) 本基金最后运作日应付赎回款已于 2024 年 9 月 26 日全部支付完毕。
- (2) 本基金最后运作日应付赎回费已于 2024 年 9 月 26 日全部支付完毕。
- (3) 本基金最后运作日应付管理费已于 2024 年 10 月 10 日全部支付。
- (4) 本基金最后运作日应付托管费已于 2024 年 10 月 10 日全部支付。
- (5) 本基金最后运作日应付销售服务费已于 2024 年 10 月 10 日全部支付。
- (6) 本基金最后运作日应付交易费用已于 2024 年 10 月 15 日全部支付。
- (7) 本基金最后运作日应付税费已于 2024 年 10 月 14 日全部支付。
- (8) 本基金最后运作日应付审计费已于 2024 年 10 月 15 日全部支付。
- (9) 本基金最后运作日应付证券清算款已于 2024 年 10 月 14 日全部支付完毕。

3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2024 年 9 月 24 日至 2024 年 10 月 16 日止清算期间
一、清算损益	
1、利息收入（注 1）	1, 530. 36
2、投资收益（注 2）	2, 550, 085. 26
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	256, 543. 16
4、赎回费收入	0. 25
清算损益小计	2, 808, 159. 03
二、清算支出	
清算支出小计（注 3）	10, 325. 00
三、清算净损益	2, 797, 834. 03

注 1：利息收入系计提的自 2024 年 9 月 24 日至 2024 年 10 月 16 日止清算期间的托管账户活期存款利息收入、最低清算备付金利息收入和结算保证金利息收入，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；A/C 类基金份额之间的收入分配按照各类别基金净值占比进行分配。

注 2：投资收益系自 2024 年 9 月 24 日至 2024 年 10 月 16 日止清算期间交易性金融资产处置变现后获取的投资收益。

注 3：清算支出所列金额包括托管账户维护费 300.00 元、银行汇划款手续费 25.00 元、律师费 10,000.00 元。

4、清算期间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 9 月 23 日）基金净资产	13,143,821.45
加：清算期间净损益	2,797,834.03
减：1, 基金赎回对价（2024 年 9 月 24 日确认的投资者赎回转出申请，于 2024 年 9 月 26 日支付）	121,508.45
二、2024 年 10 月 16 日基金净资产	15,820,147.03

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各类基金份额比例进行分配。资产处置及负债清偿后，于 2024 年 10 月 16 日本基金剩余财产为人民币 15,820,147.03 元。

自 2024 年 10 月 17 日起至清算款划出日前一日期间产生的收益或费用亦由全体基金份额持有人享有或承担。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。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1) 《华富国潮优选混合型发起式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〈华富国潮优选混合型发起式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

华富国潮优选混合型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

2024 年 10 月 16 日