

海富通惠鑫混合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：平安银行股份有限公司

清算报告出具日期：二〇二三年四月十八日

清算报告公告日期：二〇二三年五月二十六日

§1 重要提示

海富通惠鑫混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下或简称“中国证监会”）证监许可【2021】2168号文准予注册募集，《海富通惠鑫混合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2022年03月09日正式生效。本基金的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”），基金托管人为平安银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

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》等法律法规的规定和《基金合同》的有关约定，基金管理人于2023年02月08日至2023年03月13日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于海富通惠鑫混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于2023年03月14日计票表决通过了《关于海富通惠鑫混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》，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定为2023年03月14日，并于2023年03月15日进入清算程序。

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	海富通惠鑫混合型证券投资基金
基金简称	海富通惠鑫混合
基金主代码	013015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年03月09日
基金最后运作日(2023年03)	7,071,562.62份

月14日)基金份额总额	
投资目标	本基金通过积极主动的资产配置，在控制风险的前提下，积极把握证券市场的投资机会，力争实现资产的保值增值。
投资策略	<p>资产配置方面，本基金为混合型基金，对股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的10%-50%。在此约束下，本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场风险收益特征及市场行为因素等进行评估分析，对股票资产和固定收益类资产等的预期风险收益进行动态跟踪，从而构建本基金的投资组合。股票投资方面，主要有行业配置策略、个股精选策略、港股通标的股票的投资策略；债券投资主要采取利率策略、信用策略、收益率曲线策略以及杠杆策略，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>另外，本基金投资策略还包括存托凭证投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、流通受限证券投资策略等。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率× 20%+中证综合债指数收益率× 75%+恒生指数收益率（经汇率调整）× 5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，但低于股票型基金。本基金将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。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

§3 基金运作情况概述

海富通惠鑫混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可

【2021】2168 号文准予注册募集，基金合同于 2022 年 03 月 09 日正式生效，本基金共募集 243,641,031.56 份基金份额。

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》等法律法规的规定和《基金合同》的有关约定，连续 60 个工作日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，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召开基金份额持有人大会进行表决。基金管理人已就上述情形拟定了终止基金合同的解决方案，经与基金托管人协商一致后，向中国证监会提出申请，本基金于 2023 年 02 月 08 日至 2023 年 3 月 13 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于 2023 年 03 月 14 日计票表决通过了《关于海富通惠鑫混合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》及相关公告约定，本基金的最后运作日为 2023 年 03 月 14 日，自 2023 年 03 月 15 日起进入清算程序。

§4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：海富通惠鑫混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 03 月 14 日

单位：人民币元

资 产	基金最后运作日 2023年03月14日
资 产：	
银行存款	658,196.29
结算备付金	61,360.89
存出保证金	7,879.96
交易性金融资产	6,516,651.90
其中：股票投资	788,653.00
基金投资	-

债券投资	5,727,998.90
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收清算款	5,302.27
应收股利	-
应收申购款	4.50
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	7,249,395.81
负债和所有者权益	基金最后运作日 2023年03月14日
负 债:	
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	
应付赎回款	20,260.63
应付管理人报酬	1,783.34
应付托管费	445.84
应付销售服务费	57.36
应付投资顾问费	
应交税费	13.76
应付利润	
递延所得税负债	
其他负债	66,660.44
负债合计	89,221.37
净资产:	
实收基金	7,071,562.62
未分配利润	88,611.82

净资产合计	7,160,174.44
负债和净资产总计	7,249,395.81

注：本基金最后运作日 2023 年 03 月 14 日，基金份额总额 7,071,562.62 份。其中海富通惠鑫混合 A 类基金份额净值 1.0127 元，基金份额 6,413,254.69 份；海富通惠鑫混合 C 类基金份额净值 1.0108 元，基金份额 658,307.93 份。

4.2 利润表

会计主体：海富通惠鑫混合型证券投资基金

报告期间：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 03 月 14 日(基金最后运作日)

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 月 14 日 (基金最后运作日)
一、营业总收入	110,166.92
利息收入	2,932.52
其中：存款利息收入	1,356.00
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	1,576.52
证券出借利息收入	-
其他利息收入	-
投资收益(损失以“-”号填列)	-10,758.57
其中：股票投资收益	51,563.09
基金投资收益	-
债券投资收益	-62,127.56
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	-194.10
其他投资收益	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	117,988.49
汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
其他收入(损失以“-”号填列)	4.48
减：二、营业总支出	35,781.64
管理人报酬	12,496.79
托管费	3,124.25
销售服务费	1,147.15

投资顾问费	-
利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
税金及附加	13.45
其他费用	19,000.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	74,385.28
减：所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	74,385.28
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	74,385.28

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中天特审字(2023)第 2163 号标准无保留意见的审计报告。

§5 基金财产分配

本基金自 2023 年 03 月 15 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。基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

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 61,360.89 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 193.46 元，应计利息为 134.07 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 372.30 元，应计利息为 9.50 元；存放于中信建投期货有限公司备付金为 60,524.45 元，应计利息为 127.11 元。上述款项中上交所最低结算备付金将于 5 月最低备付金调整后划回托管账户，应计利息已于 2023 年 03 月 21 日划回托管账户 134.14 元，剩余部分将于本季度最低备付金结息后划回托管账户；深交所最低结算备付金已于 2023 年 04 月 11 日划回托管账户 0.42 元，剩余部分将于 5 月最低备付金调整后划回托管账户，应计利息已于 2023 年 03 月 21 日划回托管账户 9.36 元，剩余部分将于本季度最低备付金结息后划回托管账户；中信建投期货有限公司备付金

账户已于 2023 年 03 月 23 日结息，账户内剩余资金已于当日划回托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金金额 7,879.96 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 5,885.51 元，应计利息为 29.20 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 1,958.12 元，应计利息为 7.13 元。上述款项中存出保证金已于 2023 年 04 月 04 日全部划回托管账户；上交所和深交所存出保证金应计利息已于 2023 年 03 月 21 日分别划回托管账户 30.72 元和 7.71 元，剩余部分将于本季度存出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，市值为 6,516,651.90 元，已于 2023 年 03 月 30 日全部变现。

5.1.4 本基金最后运作日应收清算款 5,302.27 元，已于 2023 年 03 月 15 日划回托管账户。

5.1.5 本基金最后运作日应收申购款 4.50 元，为应收申购款利息，已于 2023 年 03 月 23 日划回托管账户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款人民币 20,260.63 元，分别于 2023 年 03 月 15 日、2023 年 03 月 16 日支付完毕。

5.2.2 本基金最后运作日的应付管理人报酬人民币 1,783.34 元，已于 2023 年 03 月 20 日支付完毕。

5.2.3 本基金最后运作日的应付托管费人民币 445.84 元，已于 2023 年 03 月 20 日支付完毕。

5.2.4 本基金最后运作日的应付销售服务费人民币 57.36 元，已于 2023 年 03 月 20 日支付完毕。

5.2.5 本基金最后运作日的应交税费人民币 13.76 元，已于 2023 年 04 月 10 日支付完毕。

5.2.6 本基金最后运作日其他负债为人民币 66,660.44 元，其中包括：

5.2.6.1 应付交易佣金人民币 1,985.44 元，已于 2023 年 04 月 17 日支付完毕。

5.2.6.2 应付中央国债登记结算有限责任公司账户维护费、中央国债登记结算有限责任公司结算服务费、中国外汇交易中心交易费用共计 4,675.00 元，已于

2023年03月21日支付完毕。

5.2.6.3 应付2022年年度审计费用人民币50,000.00元和清算审计费用人民币10,000.00元，已于2023年03月24日支付完毕。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2023年03月15日至2023年04月18日（本次清算期截止日）止
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	1,616.36
2、股票变现损益（注2）	16,238.27
2、债券变现损益（注3）	12,963.80
清算收入小计	30,818.43
二、清算净收益	30,818.43

注：

（1）利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2023年03月15日至2023年04月18日止清算期间的银行存款利息、存出保证金利息、结算备付金利息。

（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金额与最后运作日债券资产市值的差额及清算期间的债券利息，包含了交易费用及应缴税金及附加金额。

5.4 清算费用

根据基金合同第十九部分相关约定，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属于清算费用，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。

本基金清算期间未发生清算费用。

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2023年03月14日基金净资产	7,160,174.44
加：清算期间净收益	30,818.43
二、2023年04月18日基金剩余资产净值	7,190,992.87

注：截至本次清算期结束日2023年04月18日，本基金剩余财产7,190,992.87元。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。

2023年04月18日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付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结算备付金及其应计利息、应计银行存款利息和应计存出保证金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

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。

§6 备查文件

6.1 备查文件目录

- 1、海富通惠鑫混合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<海富通惠鑫混合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。

海富通惠鑫混合型证券投资基金
基金财产清算小组

二〇二三年四月十八日