

# 海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证 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：上海浦东发展银行股份有限公司

清算报告出具日期：二〇二四年一月十七日

清算报告公告日期：二〇二四年二月七日

## §1 重要提示

海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置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（以下简称“中国证监会”）证监许可【2020】1693号文准予注册募集，《海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置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2020年9月17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”），基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司（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11月22日至2023年12月22日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置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12月25日计票并表决通过了《关于海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》，本次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定为2024年1月2日，并于2024年1月3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	海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	海富通惠增一年定开
基金主代码	010130

基金运作方式	契约型开放式，以定期开放方式运作
基金合同生效日	2020年9月17日
基金最后运作日(2024年1月2日)基金份额总额	630,206.06 份
投资目标	本基金将灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>(一) 封闭期投资策略：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资组合策略；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、股指期货投资策略；7、股票期权投资策略。</p> <p>(二) 开放期投资策略：开放期内，为了保证组合具有较高的流动性，方便投资人安排投资，本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下，主要投资于具有较高流动性的投资品种，通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债-综合全价（总值）指数收益率×40%
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。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

### §3 基金运作情况概述

海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置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【2020】1693号文准予注册募集，于2020年9月17日成立并正式运作，共募集1,000,137,064.00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，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，基金管理人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，并于2023年11月22日至2023年12月22日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会，于2023年12月25日计票并表决通过了《关于海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置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》及相关公告规定，本基金的最后运作日确定为2024年1月2日，清算期间为2024年1月3日至2024年1月17日。

## §4 财务报告

### 4.1 资产负债表

会计主体：海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金  
报告截止日：2023年12月31日和2024年1月2日

单位：人民币元

资产	基金最后运作日 2024年1月2日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	316,828.89	316,835.31
结算备付金	95,893.88	95,885.26
存出保证金	30,459.29	30,456.55
交易性金融资产	220,500.00	252,060.00
其中：股票投资	220,500.00	252,060.00
基金投资		
债券投资		
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	30,381.82	
应收股利		
应收申购款		
递延所得税资产		
其他资产		
资产总计	694,063.88	695,237.12
<b>负债和净资产</b>	<b>基金最后运作日</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2024年1月2日</b>	<b>2023年12月31日</b>
<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		
应付赎回款	15.29	15.18
应付管理人报酬	556.88	508.71
应付托管费	92.81	84.78
应付销售服务费	0.68	0.62
应付投资顾问费		
应交税费		
应付利润		
递延所得税负债		
其他负债	204,394.32	204,371.92
负债合计	205,059.98	204,981.21
<b>净资产：</b>		
实收基金	630,206.06	630,215.94
未分配利润	-141,202.16	-139,960.03
净资产合计	489,003.90	490,255.91
负债和净资产总计	694,063.88	695,237.12

注：截止本基金最后运作日2024年1月2日，基金份额总额630,206.06份。其

中A类基金份额总额628,059.62份，基金份额净值0.7760元；C类基金份额总额2,146.44份，基金份额净值0.7657元。上年度末2023年12月31日，基金份额总额630,215.94份。其中A类基金份额总额628,069.50份，基金份额净值0.7780元；C类基金份额总额2,146.44份，基金份额净值0.7677元。

#### 4.2利润表

会计主体：海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告期间：2023年1月1日至2023年12月31日和2024年1月1日至2024年1月2日(基金最后运作日)

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至 2024年1月2日 (基金最后运作日)	2023年1月1日至 2023年12月31日
一、营业总收入	-1,183.06	-5,506,539.55
利息收入	17.52	27,566.78
其中：存款利息收入	17.52	27,566.78
债券利息收入		
资产支持证券利息收入		
申购款利息收入		
其他利息收入		
投资收益(损失以“-”填列)	-466.31	-5,835,473.77
其中：股票投资收益	-466.31	-6,324,126.24
基金投资收益		
债券投资收益		
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		488,652.47
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-734.27	301,367.44
汇兑收益(损失以“-”号填列)		
其他收入(损失以“-”号填列)		
减：二、营业总支出	61.26	842,306.14

管理人报酬	48.17	622,022.09
托管费	8.03	87,014.83
销售服务费	0.06	10.54
利息支出		
其中：卖出回购金融资产支出		
税金及附加		
其他费用	5.00	133,258.68
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-1,244.32	-6,348,845.69
减：所得税费用		
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-1,244.32	-6,348,845.69
五、其他综合收益的税后净额		
六、综合收益总额	-1,244.32	-6,348,845.69

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(2024)第 0099 号标准无保留意见的审计报告。

## §5 基金财产分配

本基金自 2024 年 1 月 3 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、清算期间的清算损益、清算费用及资产处置及负债清偿后的剩余资产情况如下：

### 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 95,893.88 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 47,334.94 元，应计利息为 27.69 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 48,502.91 元，应计利息为 28.34 元。上述款项中上交所最低结算备付金已于 2024 年 1 月 9 日划回托管账户 44,815.87 元；深交所最低结算备付金已于 2024 年 1 月 9 日划回托管账户 46,119.92 元。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金金额 30,459.29 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 14,725.17 元，应计利息为 8.58 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 15,716.31 元，应计利息为 9.23 元。上述款项中上交所存出保证金已于 2024 年 1 月 3 日划回托管账户 2,928.27 元；深交所存出保证金已于 2024 年 1 月 3 日划回托管账户 2,228.83 元。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产为股票资产，市值为 220,500.00 元，已于 2024 年 1 月 3 日至 2024 年 1 月 5 日期间内全部卖出变现，卖出成交金额 215,293.99 元，交易费用 281.23 元。变现金额已于 2024 年 1 月 4 日、2024 年 1 月 5 日、2024 年 1 月 8 日全部划回托管账户。

5.1.4 本基金最后运作日应收清算款 30,381.82 元，为最后运作日卖出股票清算款，已于 2024 年 1 月 3 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 15.29 元，分别于 2024 年 1 月 3 日、2024 年 1 月 4 日支付完毕。

5.2.2 本基金最后运作日的应付管理人报酬 556.88 元，分别于 2024 年 1 月 3 日、2024 年 1 月 10 日支付完毕。

5.2.3 本基金最后运作日的应付托管费 92.81 元，分别于 2024 年 1 月 3 日、2024 年 1 月 10 日支付完毕。

5.2.4 本基金最后运作日的应付销售服务费 0.68 元，分别于 2024 年 1 月 3 日、2024 年 1 月 10 日支付完毕。

5.2.5 本基金最后运作日其他负债 204,394.32 元，其中包括：

5.2.5.1 应付交易佣金 94,251.36 元，已于 2024 年 1 月 10 日支付完毕。

5.2.5.2 应付证券时报信息披露费用 66,306.16 元，已于 2024 年 1 月 15 日支付完毕。

5.2.5.3 应付审计费用 43,836.80 元，已于 2024 年 1 月 16 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2024年1月3日至2024年1月17日（本次清算期截止日）止
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	121.76
2、股票变现损益（注2）	-5,487.24
清算收入小计	-5,365.48
二、清算费用	
1、银行汇划手续费	75.00
清算费用小计	75.00
三、清算净收益	-5,440.48

注：

（1）利息收入金额 121.76 元，系以当前适用利率计提的自 2024 年 1 月 3 日至 2024 年 1 月 17 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。

（2）股票变现损益为本次清算期间股票资产卖出金额扣除交易费用后与最后运作日股票资产市值的差额。

#### 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银行汇划手续费 75.00 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

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2024 年 1 月 2 日基金净资产	489,003.90
加：清算期间净收益	-5,440.48

加：清算期间基金份额交易产生的净值影响	-1,349.13
二、2024年1月17日基金剩余资产净值	482,214.29

注：截至本次清算期结束日2024年1月17日，本基金剩余财产482,214.29元。上述财产将根据本基金的《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。

2024年1月17日至清算款划出日前一日的银行存款、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进行分配。

# §6 备查文件

## 6.1 备查文件目录

- 1、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置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<海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置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。

海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金  
基金财产清算小组

二〇二四年一月十七日