

# 华安丰利 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：华安基金管理有限公司

基金托管人：渤海银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月九日

## §1 重要提示

华安丰利 18 个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”), 系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[2016] 1190 号《关于准予华安丰利 18 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》及机构部函[2017] 1165 号《关于同意华安丰利 18 个月定期开放债券型证券投资基金延期募集备案的回函》准予注册, 由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集, 基金合同于 2018 年 2 月 9 日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。设立时募集的规模为 232,072,417.50 份基金份额。本基金的基金管理人及登记机构为华安基金管理有限公司, 基金托管人为渤海银行股份有限公司。

根据《华安丰利 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》”)第二十部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定:“有下列情形之一的,《基金合同》应当终止: 1、基金份额持有人大会决定终止的; 2、基金管理人、基金托管人职责终止, 在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的; 3、《基金合同》生效后, 在每个开放期届满时, 基金规模低于 2 亿元的; 4、《基金合同》约定的其他情形; 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。”根据基金管理人 2018 年 6 月 12 日发布的《关于华安丰利 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表决结果暨决议生效的公告》, 本基金基金份额持有人大会于 2018 年 6 月 11 日表决通过了《关于终止华安丰利 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》, 大会决议自该日起生效, 本基金自 2018 年 6 月 23 日起进入清算程序。

由基金管理人华安基金管理有限公司、基金托管人渤海银行股份有限公司、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于 2018 年 6 月 25 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序, 并由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计, 上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

## §2 基金产品概况

基金简称	华安丰利 18 个月定开债
基金主代码	002950
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2018年2月9日
报告期末(2018年6月22日)基金份额总额	40,892.55份
投资目标	在合理控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理把握债券市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将通过对宏观经济运行情况、国家货币及财政政策、资本市场资金环境等重要因素的研究和预测，结合投资时钟理论并利用公司研究开发的多因子模型等数量工具，优化基金资产在利率债、信用债以及货币市场工具等各类固定收益类金融工具之间的配置比例。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中债综合全价指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期的风险和收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险投资品种。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	渤海银行股份有限公司

### §3 基金运作情况概述

本基金系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[2016] 1190 号《关于准予华安丰利 18 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》及机构部函[2017] 1165 号《关于同意华安丰利 18 个月定期开放债券型证券投资基金延期募集备案的回函》准予注册，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2018 年 2 月 9 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的规模为 232,072,417.50 份基金份额。

根据《基金合同》的约定以及基金管理人 2018 年 6 月 12 日发布的《关于华安丰利 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表决结果暨决议生效的公告》，本基金基金份额持有人大会于 2018 年 6 月 11 日表决通过了《关于终止华安丰利 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，大会决议自该日起生效。根据决议生效公告，本基金最后运作日为 2018 年 6 月 22 日，自 2018 年 6 月 23 日起进入清算程序。自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

## §4 财务报告

### 4.1 资产负债表

会计主体：华安丰利 18 个月定期开放债券型证券投资基金  
 报告截止日：2018 年 6 月 22 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2018年6月22日
<b>资 产：</b>	
银行存款	28,483,368.51
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
应收利息	2,886.96
资产总计	28,486,255.47
负债和所有者权益	最后运作日 2018年6月22日

<b>负 债:</b>	
应付赎回款	28,387,986.57
应付管理人报酬	37,994.71
应付托管费	12,664.91
应付销售服务费	0.66
应付交易费用	-
其他负债	-
负债合计	28,438,646.85
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	40,892.55
未分配利润	6,716.07
所有者权益合计	47,608.62
负债和所有者权益总计	28,486,255.47

注：本财务报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师蒋燕华、骆文慧签字出具了安永华明(2018)专字第 60971571\_B10 号标准无保留意见的审计报告。

## §5 基金财产分配

自 2018 年 6 月 23 日至 2018 年 6 月 29 日止清算期间，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 本基金最后运作日应收银行存款利息为人民币 2,886.96 元,该款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 6 月 21 日划入托管账户。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。

### 5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 28,387,986.57 元，该款项已于 2018 年 6 月 25 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 37,994.71 元，该款项已于 2018 年 6 月 25 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 12,664.91 元，该款项已于 2018 年 6 月 25 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 0.66 元，该款项已于 2018 年 6 月 25 日支付。

### 5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自 2018 年 6 月 23 日 至 2018 年 6 月 29 日 止清算期间
一、清算损益	
1、利息收入（注 1）	1,902.84
清算损益小计	1,902.84
二、清算费用	
清算费用小计（注 2）	-
三、清算净损益	1,902.84

注 1：利息收入系计提的自 2018 年 6 月 23 日至 2018 年 6 月 29 日止清算期间的银行存款利息。该款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 6 月 21 日划入托管账户。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。

注 2：根据《关于华安丰利 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表决结果暨决议生效的公告》，本次清算期间产生的清算费用由本基金管理人代为支付。

### 5.4 资产处置及负债清偿后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2018年6月22日基金净资产	47,608.62
加：清算期间净损益	1,902.84
减：基金净赎回转出金额	-
二、2018年6月29日基金净资产	49,511.46

根据本基金的《基金合同》及《关于华安丰利 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表决结果暨决议生效的公告》，将基金财产清算后的全部剩余资产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。

资产处置及负债清偿后，本基金截至 2018 年 6 月 29 日止的剩余财产为人民币 49,511.46 元。

截至 2018 年 6 月 29 日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币 94,721.66 元，其中人民币 50,000.00 元系基金管理人代垫的足以清偿以当前适用的利率预估的银行存款利息的款项。

若本基金后续清算，出现账面剩余资产不足以支付相关负债的，基金管理人负有义务于收到基金托管人通知后当日内将款项补足。

## 5.5 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。

## §6 备查文件

### 6.1 备查文件目录

- 1、华安丰利 18 个月定期开放债券型证券投资基金 2018 年 6 月 22 日资产负债表及审计报告
- 2、《华安丰利 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

### 6.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站

<http://www.huaan.com.cn>。

### 6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安丰利 18 个月定期开放债券型证券投资基金  
基金财产清算小组

二〇一八年六月二十九日（清算报告出具日）