

富国汇诚18个月封闭式债券型证券投资基金

清算报告

2024年9月13日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

公告日期：2024年9月18日

一、重要提示及目录

1、重要提示

富国汇诚 18 个月封闭式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[2022]3244 号《关于准予富国汇诚 18 个月封闭式债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2023 年 2 月 28 日正式生效，首次设立募集规模为 6,276,871,089.67 份基金份额。本基金为契约型封闭式，存续期为 18 个月。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《富国汇诚 18 个月封闭式债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）第三部分“基金的基本情况”之“七、基金存续期限”约定：“除根据本基金合同约定提前终止外，本基金存续期为 18 个月，即自基金合同生效日起至基金合同生效日所对应的 18 个月月度对日止。”。

根据《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”之“二、基金合同的终止事由”有以下约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，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、基金合同约定的存续期届满；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。”

根据基金管理人于 2024 年 8 月 29 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国汇诚 18 个月封闭式债券型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 2023 年 2 月 28 日，存续期到期日为 2024 年 8 月 28 日。本基金将根据基金合同约定于存续期到期日次日（即 2024 年 8 月 29 日）起进入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。

本基金清算期自 2024 年 8 月 29 日至 2024 年 8 月 30 日止。由基金管理人富国基金管理有限公司、基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司、安永华明会计师事务所

所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2024 年 8 月 29 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，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

2、目录

一、重要提示及目录.....	2
1、重要提示.....	2
2、目录.....	4
二、基金概况.....	5
三、财务会计报告.....	5
四、清盘事项说明.....	6
1、基金基本情况.....	6
2、清算原因.....	7
3、清算起始日.....	7
4、清算财务报表编制基础.....	7
五、清算情况.....	8
1、资产处置情况.....	8
2、负债清偿情况.....	8
3、清算期间的清算损益情况.....	9
4、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况.....	9
6、基金财产清算报告的告知安排.....	10
六、备查文件目录.....	10
1、备查文件目录.....	10
2、存放地点.....	10
3、查阅方式.....	10

二、基金概况

- 1、基金名称：富国汇诚 18 个月封闭式债券型证券投资基金
- 2、基金简称：富国汇诚 18 个月封闭式债券
- 3、基金运作方式：契约型，封闭式
- 4、基金合同生效日：2023 年 2 月 28 日
- 6、基金管理人：富国基金管理有限公司
- 7、基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司
- 8、最后运作日（2024 年 8 月 28 日）基金份额总额：6,276,871,089.67
- 9、最后运作日（2024 年 8 月 28 日）基金资产净值：6,422,671,782.12 元

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：富国汇诚 18 个月封闭式债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 8 月 28 日

单位：人民币元

	最后运作日 2024 年 8 月 28 日
资产：	
货币资金	6,426,479,506.53
结算备付金	84,246,823.04
存出保证金	1,394.02
资产总计	6,510,727,723.59
负债：	
应付管理人报酬	1,521,748.57
应付托管费	253,624.76
应付销售服务费	14,610.25
应交税费	876,927.56
其他负债	85,389,030.33
负债合计	88,055,941.47
净资产：	
实收基金	6,276,871,089.67
未分配利润	145,800,692.45
净资产合计	6,422,671,782.12
负债和净资产总计	6,510,727,723.59

四、清盘事项说明

1、基金基本情况

富国汇诚18个月封闭式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[2022]3244号《关于准予富国汇诚18个月封闭式债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2023年2月28日正式生效，首次设立募集规模为6,276,871,089.67份基金份额。本基金为契约型封闭式，存续期为18个月。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、政府支持债券、政府支持机构债券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、现金等货币市场工具、信用衍生品、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不直接从二级市场买入股票，但可持有因可转换债券转股所形成的股票。因上述原因持有的股票，本基金将在其可交易之日的10个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，存续期到期日前3个月内不受此比例限制；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金业绩比较基准：中债综合全价（总值）指数收益率×90%+1年期定期存款利率（税后）×10%。

2、清算原因

根据《富国汇诚 18 个月封闭式债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）第三部分“基金的基本情况”之“七、基金存续期限”约定：“除根据本基金合同约定提前终止外，本基金存续期为 18 个月，即自基金合同生效日起至基金合同生效日所对应的 18 个月月度对日止。”

根据《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”之“二、基金合同的终止事由”有以下约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，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、基金合同约定的存续期届满；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。”

根据基金管理人于 2024 年 8 月 29 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国汇诚 18 个月封闭式债券型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 2023 年 2 月 28 日，存续期到期日为 2024 年 8 月 28 日。本基金将根据基金合同约定于存续期到期日次日（即 2024 年 8 月 29 日）起进入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。

3、清算起始日

根据《富国基金管理有限公司关于富国汇诚 18 个月封闭式债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金自 2024 年 8 月 29 日起进入清算期，故本基金清算起始日为 2024 年 8 月 29 日。

4、清算财务报表编制基础

本基金的清算财务报表是在非持续经营的前提下参考财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算财务报表并无比较期间的相关数据列示。

五、清算情况

自2024年8月29日至2024年8月30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：

1、资产处置情况

(1)本基金最后运作日货币资金为人民币6,426,479,506.53元，其中存放于托管账户人民币6,426,405,700.52元，应计银行存款利息人民币73,806.01元。上述应计银行存款利息将于2024年8月30日后划入托管账户。

(2)本基金最后运作日结算备付金为人民币84,246,823.04元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金人民币82,654,812.34元，应计结算备付金利息人民币286,364.24元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金人民币1,304,413.76元，应计结算备付金利息人民币1,232.70元。上述款项将于2024年8月30日后划入托管账户。

2、负债清偿情况

(1)本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币1,521,748.57元，该款项将于2024年8月30日后支付。

(2)本基金最后运作日应付托管费为人民币253,624.76元，该款项将于2024年8月30日后支付。

(3)本基金最后运作日应付销售服务费（C类基金份额销售服务费）为人民币14,610.25元，该款项将于2024年8月30日后支付。

(4)本基金最后运作日应交税费为人民币876,927.56元，该款项将于2024年8月30日后支付。

(5)本基金最后运作日其他负债为人民币85,389,030.33元，其中应付交易费用人民币94,192.77元，应付管理人垫资款人民币85,000,000.00元，应付上清所查询费人民币300.00元，应付汇款费人民币537.56元，应付清算律师费20,000.00元，应付账户维护费9,000.00元，应付2023年度财务报表审计费人民币65,000.00元，预提清算财务报表审计费人民币20,000.00元，预提证券时报披露费人民币180,000.00元，上述款项中应付汇款费已于2024年8月29日支付人民币200.00元，其余款项将于2024年8月30日后支付。

3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2024年8月29日至2024年8月30日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	7,629.06
清算收益小计	7,629.06
二、清算费用	
清算费用小计	-
三、清算净收益（净损失以“-”号填列）	7,629.06

注1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2024年8月29日至2024年8月30日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

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2024年8月28日基金净资产	6,422,671,782.12
加：清算期间净收益（净损失以“-”号填列）	7,629.06
减：基金净赎回转出金额 （于2024年8月29日确认的自动赎回（注1））	6,422,671,782.12
二、2024年8月30日基金净资产	7,629.06

注1：根据《基金合同》第三部分“基金的基本情况”之八“基金的自动赎回”约定：

“本基金将在存续期到期日对基金份额进行自动赎回，按已变现的基金财产支付部分赎回款项，基金管理人将在T+7日内（含）将已变现的基金财产对应款项按基金份额持有人持有的基金份额比例自动赎回给本基金全体基金份额持有人。”。

根据中国证券登记结算有限责任公司《结算备付金管理办法》和《结算保证金管理办法》，结算备付金及存出保证金将于下一调整日后划入基金托管账户。为保护基金份额持有人利益，基金管理人以自有资金先行垫付部分赎回款项，已于2024年8月28日划入托管账户。本基金于2024年8月29日根据基金的自动赎回的约定按2024年8月28日基金净资产支付赎回款项。基金管理人垫付的资金及垫付期间孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

资产处置及负债清偿后，本基金截至2024年8月30日止的剩余财产为人民币7,629.06元，为基金管理人垫付资金期间孳生的利息，将于清算期后返还给基金管理人。

截至2024年8月30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（不含应计利息）余额共计人民币3,733,718.40元，系基金管理人垫付的资金扣除已划付款项后的余额。

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，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 《富国汇诚 18 个月封闭式债券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《富国汇诚 18 个月封闭式债券型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。

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。

富国汇诚 18 个月封闭式债券型证券投资基金财产清算小组

2024 年 9 月 18 日