

恒生前海兴享混合型证券投资基金

清算报告

基金管理人：恒生前海基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告出具日期：2025年2月14日

报告公告日期：2025年2月21日

§1 重要提示

恒生前海兴享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[2021]4012号文核准募集，《恒生前海兴享混合型证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)于2022年9月15日正式生效，本基金的基金管理人为恒生前海基金管理有限公司(以下简称“管理人”),基金托管人为兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”。

鉴于市场环境的变化，为保护基金份额持有人利益，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》的有关规定和《基金合同》的约定，本基金以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议并表决通过了《关于终止恒生前海兴享混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告详见2025年1月23日刊登在《证券时报》、基金管理人网站(<https://www.hsqhfunds.com>)、中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)上的《恒生前海兴享混合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公告》。本基金管理人按照《基金合同》的约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。本基金的基金最后运作日定为2025年1月23日，并于2025年1月24日进入清算期。

本基金管理人恒生前海基金管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2025年1月24日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所(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事宜出具法律意见。

§2 基金概况

| | |
|-----------------------------------|---|
| 基金名称 | 恒生前海兴享混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 恒生前海兴享混合 |
| 基金主代码 | 014744 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022年9月15日 |
| 基金最后运作日 (2025年1月23日) 基金份额总额 | 962,756.70份 |
| 投资目标 | 在严格控制投资组合风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，力争基金资产的稳健增值。 |

| | |
|--------|---|
| 投资策略 | 本基金将采用“自上而下”的策略进行基金的大类资产配置，主要通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济走势、市场政策、利率走势、证券市场估值水平等可能影响证券市场的重要因素，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳健增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×70%+中债综合全价（总值）指数收益率×30% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，理论上其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 恒生前海基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |

§3 财务报表

资产负债表（已经审计）

会计主体：恒生前海兴享混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 1 月 23 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

| 资产 | 基金最后运作日 2025年1月23日 |
|---------------|-------------------------------|
| 资产： | |
| 货币资金 | 660,782.35 |
| 结算备付金 | 429.15 |
| 存出保证金 | 1,253.62 |
| 资产总计 | 662,465.12 |
| 负债和净资产 | 基金最后运作日 2025年1月23日 |
| 负债： | |
| 应付赎回款 | 60,780.89 |
| 应付管理人报酬 | 234.20 |
| 应付托管费 | 58.54 |
| 应付销售服务费 | 46.75 |
| 其他负债 | 12,363.45 |
| 负债合计 | 73,483.83 |
| 净资产： | |
| 实收基金 | 962,756.70 |
| 未分配利润 | -373,775.41 |
| 净资产合计 | 588,981.29 |
| 负债和净资产总计 | 662,465.12 |

注：报告截止日 2025 年 1 月 23 日（基金最后运作日），恒生前海兴享混合 A 基金份额净值

0.6123 元，基金份额总额 487,937.63 份；恒生前海兴享混合 C 基金份额净值 0.6112 元，基金份额总额 474,819.07 份。恒生前海兴享混合份额总额合计为 962,756.70 份。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，本清算报告并无比较期间的相关数据列。

§4 基金财产分配

本基金自 2025 年 1 月 24 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：

4.1 资产处置情况

(1) 本基金截止最后运作日的银行存款为人民币 660,782.35 元，其中本金为人民币 660,484.82 元，应计利息为人民币 297.53 元，基金管理人在支付清算款之日以自有资金垫付银行存款应计利息款项。

(2) 本基金截止最后运作日的结算备付金为人民币 429.15 元，其中本金为人民币 428.52 元，应计利息为人民币 0.63 元。基金管理人在支付清算款之日以自有资金垫付剩余结算备付金本金和应计利息款项。

(3) 本基金截止最后运作日的存出保证金为人民币 1,253.62 元，其中本金为人民币 1,252.49 元，应计利息为人民币 1.13 元。基金管理人在支付清算款之日以自有资金垫付剩余存出保证金本金和应计利息款项。

4.2 负债清偿情况

(1) 本基金截止最后运作日的应付赎回款为人民币 60,780.89 元，该款项分别于 2025 年 2 月 6 日前支付。

(3) 本基金截止最后运作日的应付管理人报酬为人民币 234.20 元，该款项于 2025 年 2 月 7 日支付。

(4) 本基金截止最后运作日的应付托管费为人民币 58.54 元，该款项于 2025 年 2 月 7 日支付。

(5) 本基金截止最后运作日的应付销售服务费为人民币 46.75 元，该款项于 2025 年 2 月 7 日支付。

(6) 本基金截止最后运作日的其他负债为人民币 12,363.45 元，包含应付交易费用人民币 167.34 元、预提审计费人民币 12,195.86 元、应付赎回费人民币 0.25 元。截至清算期

结束日，其他负债均已支付完毕。（注：该基金属于迷你基金，根据监管要求，公司需要承担部分固定费用，基金清算审计费金额共计 18,000.00 元，其中基金管理人承担人民币 5,804.14 元，基金承担人民币 12,195.86 元）。

4.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目 | 自 2025 年 1 月 24 日起至 2025 年 2 月 13 日止清算期间 |
|-------------|--|
| 一、清算收益 | |
| 1、利息收入（注 1） | 314.39 |
| 2、其他收入（注 2） | 728.09 |
| 清算收入小计 | 1,042.48 |
| 二、清算费用 | |
| 1、其他费用（注 3） | 135.00 |
| 清算费用小计 | 135.00 |
| 三、清算净收益 | 907.48 |

注 1：利息收入系清算期间的银行存款利息收入及存出保证金利息收入。

注 2：其他收入系 2025 年 1 月 23 日提出的赎回申请对应的赎回费收入。

注 3：其他费用系清算期间银行汇划费。

4.4 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 2025 年 1 月 23 日基金净资产 | 588,981.29 |
| 减：基金赎回金额（于 2025 年 1 月 23 日提出的投资者赎回申请） | 141,511.34 |
| 加：清算期间净收益 | 907.48 |
| 二：本次清算结束日 2025 年 2 月 13 日基金净资产 | 448,377.43 |

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，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，按运作终止日基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人。

自清算期结束日次日至清算款划出日前一日的归属于基金份额持有人的银行存款、结算

备付金、存出保证金孳生的利息归基金份额持有人所有，最终支付清算款金额以本基金登记机构的记录为准。基金管理人垫付的资金自资金到账日起至托管户销户为止孳生的利息归基金管理人所有，在托管户销户前向基金管理人支付垫付资金及其孳生的利息。

4.5 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，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。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。

§5 备查文件

5.1 备查文件目录

- (1)《恒生前海兴享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<恒生前海兴享混合型证券投资基金清算报告>的法律意见》

5.2 存放地点

广东省深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心 T2 写字楼 1001。

5.3 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。

恒生前海兴享混合型证券投资基金

基金财产清算小组

2025 年 2 月 21 日