

海富通富利三个月持有期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：中信银行股份有限公司

清算报告出具日期：二〇二五年十二月三十一日

清算报告公告日期：二〇二六年一月二十日

§1 重要提示

海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经 2020 年 11 月 17 日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】3093 号文准予注册募集。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”), 基金托管人为中信银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。《海富通富利三个月持有期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 2021 年 7 月 20 日正式生效。基金类型为契约型、开放式。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, 基金管理人以通讯方式召开了基金份额持有人大会, 大会表决投票时间为 2025 年 11 月 14 日至 2025 年 12 月 15 日的期间, 于 2025 年 12 月 16 日计票并表决通过《关于终止海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金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 2025 年 12 月 17 日, 并于 2025 年 12 月 18 日进入清算程序。

基金管理人、基金托管人、毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于 2025 年 12 月 18 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序, 并由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计, 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

基金名称	海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金
基金简称	海富通富利三个月持有
基金主代码	010850
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2021年7月20日

基金最后运作日（2025年12月17日）基金份额总额	15,904,058.22份	
下属分级基金的基金简称	海富通富利三个月持有A	海富通富利三个月持有C
下属分级基金的交易代码	010850	010851
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。	
投资策略	<p>本基金通过对宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究，同时紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素，兼顾经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动，结合投资时钟理论，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例。并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，或借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应，以规避或分散市场风险。</p> <p>股票投资方面，本基金将采用量化选股策略、风险估测模型——有效控制预期风险、交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩、投资组合的优化及调整、港股通标的股票的投资策略等策略。</p> <p>债券投资方面，本基金将采用利率策略、信用策略、收益率曲线策略、杠杆策略等策略。</p>	
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	中信银行股份有限公司	

§3 基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可【2020】3093号文准予注册募集。本基金为契约型、开放式证券投资基金，基金简称为海富通富利三个月持有A（基金代码：010850），海富通富利三个月持有C（基金代码：010851）。《基金合同》于2021年7月20日正式生效，共募集277,641,140.11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管理办法》等法律法规的规定和《基金合同》的有关约定，《基金合同》生效后，连续20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，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，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。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。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并履行规定程序后，以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会表决投票时间为2025年11月14日至2025年12月15日期间，于2025年12月16日计票并表决通过了《关于终止海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金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2025年12月17日，清算期间为2025年12月18日至2025年12月31日。

§4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2025年12月17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12月17日
----	------------------------

资产:	
货币资金	7,354,494.92
结算备付金	784,432.02
存出保证金	460.02
交易性金融资产	915,642.95
其中: 股票投资	7,299.09
基金投资	
债券投资	908,343.86
资产支持证券投资	
贵金属投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	6,000,168.76
应收清算款	740,816.83
应收股利	
应收申购款	99.21
递延所得税资产	
其他应收款	59,600.00
资产总计	15,855,714.71
负债和所有者权益	基金最后运作日 2025年12月17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	3,359.90
应付管理人报酬	6,285.74
应付托管费	1,178.59

应付销售服务费	2,205.07
应付投资顾问费	
应交税费	125.01
应付利润	
递延所得税负债	
其他负债	22,723.07
负债合计	35,877.38
所有者权益:	
实收基金	15,904,058.22
未分配利润	-84,220.89
所有者权益合计	15,819,837.33
负债和所有者权益总计	15,855,714.71

注: 1. 截至本基金最后运作日2025年12月17日, 基金份额总额15,904,058.22份。其中海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金A类基金份额总额4,622,206.56份, 基金份额净值1.0070元; 海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金C类基金份额总额11,281,851.66份, 基金份额净值0.9897元。

2. 本财务报告已经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计, 注册会计师叶凯韵、侯雯签字出具了毕马威华振审字第2600002号标准无保留意见的审计报告。

§5 清算情况

自2025年12月18日至2025年12月31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 本基金最后运作日货币资金金额7,354,494.92元, 其中存放于托管账户

的银行存款为 7,349,667.19 元，应计银行存款利息为 4,827.73 元。上述应计银行存款利息于 2025 年 12 月 21 日结息时划回托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金金额 784,432.02 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 155,000.00 元，应计利息为 78.20 元；存放于海通期货期货备付金为 627,538.92 元，应计利息为 1,814.90 元。上述款项中上交所最低结算备付金预计将于 2026 年 2 月初全部划回托管户，应计利息将于每季度最低备付金结息后划回托管账户，上述海通期货备付金利息于 2025 年 12 月 31 日期货备付金结息时划回海通期货备付金账户。截至 2026 年 1 月 6 日，期货备付金账户余额及应计利息已全部划回托管账户。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金金额 460.02 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 436.54 元，应计利息为 0.72 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 22.76 元。上述款项中上交所和深交所的保证金已于 2026 年 1 月 6 日全部划回托管户，应计利息已于 2025 年 12 月 22 日划回托管账户。

5.1.4 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，市值分别为 7,299.09 元和 908,343.86 元。股票资产已于 2025 年 12 月 18 日全部变现，卖出成交金额 7,326.97 元，交易费用 7.34 元，补缴股息红利税 1,989.48 元。债券资产已于 2025 年 12 月 18 日全部变现，卖出成交总额 908,377.64 元。截至 2025 年 12 月 19 日，上述变现金额已全部划回托管账户。

5.1.5 本基金最后运作日买入返售金融资产为交易所逆回购余额 6,000,168.76 元，分别于 2025 年 12 月 22 日、2025 年 12 月 23 日划回托管账户。

5.1.6 本基金最后运作日应收清算款金额 740,816.83 元，已于 2025 年 12 月 18 日划回托管账户。

5.1.7 本基金最后运作日其他资产为其他应收款，金额 59,600.00 元，其中 2026 年 1 月中央国债登记结算有限责任公司账户维护费 1,500.00 元已于 2025 年 12 月 24 日冲销，2026 年 1 月银行间市场清算所股份有限公司账户维护费 1,500.00 元和银行间市场清算所股份有限公司查询服务费 100.00 元已于 2026 年 1 月 5 日冲销，剩余 56,500.00 元已于 2026 年 1 月 9 日划入托管账户。

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 3,359.90 元，于 2025 年 12 月 19 日支付完毕。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬 6,285.74 元，该款项已于 2025 年 12 月 26 日支付完毕。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费 1,178.59 元，该款项已于 2025 年 12 月 26 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 2,205.07 元，该款项已于 2025 年 12 月 26 日支付完毕。

5.2.5 本基金最后运作日的应交税费人民币 125.01 元，该款项已于 2025 年 12 月 26 日支付完毕。

5.2.6 本基金最后运作日其他负债 22,723.07 元，其中包括：

5.2.6.1 应付交易佣金人民币 323.07 元，已于 2025 年 12 月 26 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 6,000.00 元，其中 2025 年 4 季度费用 4,500.00 元已于 2025 年 12 月 24 日支付完毕，2026 年 1 月 费用 1,500.00 元已于 2025 年 12 月 24 日冲销。银行间市场清算所股份有限公司 账户维护费、银行间市场清算所股份有限公司客户端查询费共计 6,400.00 元， 其中 2025 年 4 季度费用 4,800.00 元已于 2026 年 1 月 5 日支付完毕，2026 年 1 月费用 1,600.00 元已于 2026 年 1 月 5 日冲销。

5.2.6.3 应付审计费 10,000.00 元，2025 年度审计费 10,000.00 元已于 2026 年 1 月 12 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2025年12月18日至2025年12月31日止清算期间
一、 清算收益	
1、 利息收入（注 1）	2,836.59
2、 股票变现损益（注 2）	-1,968.94
3、 债券变现损益（注 3）	33.78

4、其他业务收入（注 4）	0.3
清算收入小计	901.73
二、清算费用	
1、银行汇划手续费（注 5）	500.00
2、其他费用（注 6）	3.65
清算费用小计	503.65
三、清算净收益	398.08

注：（1）利息收入金额 2,836.59 元，系以当前适用利率计提的自 2025 年 12 月 18 日至 2025 年 12 月 31 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息以及买入返售金融资产利息收入。

（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总额与最后运作日债券资产市值的差额。

（4）其他业务收入系基金赎回费归入基金资产的收入。

（5）本基金清算期间预提的银行汇划手续费 500.00 元，从基金财产中支付。

（6）其他费用系税金及附加费用。

5.4 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 12 月 17 日基金净资产	15,819,837.33
加：清算期间净收益	398.08
减：基金净赎回转出金额（于 2025 年 12 月 18 日确认的投资者赎回转出申请）	158,005.92
二、2025 年 12 月 31 日基金剩余资产净值	15,662,229.49

注：资产处置及负债清偿后，本基金截至 2025 年 12 月 31 日的剩余财产净值为人民币 15,662,229.49 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。

自 2026 年 1 月 1 日至清算款划出前一日的银行存款、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。

5.5 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、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金清算财务报告及审计报告
- 2、关于海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金清算事宜之法律意见

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。

海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金
基金财产清算小组

二〇二五年十二月三十一日