

恒越安裕纯债债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：恒越基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

清算报告出具日：2026 年 7 月 9 日

清算报告送出日：2026 年 7 月 21 日

§ 1 重要提示

恒越安裕纯债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〔2023〕985号《关于准予恒越安裕纯债债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，于2023年6月26日成立并正式运作。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）和《恒越安裕纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金于2026年6月22日召开了基金份额持有人大会，对《关于终止恒越安裕纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》进行了表决。本次基金份额持有人大会决议生效后，根据基金份额持有人大会通过的本次会议议案及说明，自本次持有人大会决议生效并公告后的下一个工作日起（2026年6月24日），本基金进入基金财产清算程序，基金管理人不再接受持有人提出的份额申购、赎回、转换申请。本基金的最后运作日为2026年6月23日，根据《基金合同》中有关基金财产清算的规定，成立基金财产清算小组，进行财产清算。

基金管理人恒越基金管理有限公司、基金托管人浙商银行股份有限公司、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 基金产品概况

基金名称	恒越安裕纯债债券型证券投资基金
基金简称	恒越安裕纯债债券
基金代码	018516
基金运作方式	契约型开放式。
基金合同生效日	2023年6月26日
最后运作日(2026年6月23日)基金份额总额	1,445,283.82份
投资目标	在严格控制投资组合风险和保持资产流动性的前提下，通过积极的组

	合管理，力争实现组合的稳健增值。
投资策略	本基金在保证资产流动性的基础上，通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等影响市场利率的主要因素进行深入研究，对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响债券价格的因素进行评估，在债券组合久期调整及期限结构配置基础上，对不同投资品种采取不同的投资策略。在严格控制组合风险的前提下，把握债券市场的投资机会，力争实现组合的稳健增值。
业绩比较基准	中债新综合全价（总值）指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。
基金管理人	恒越基金管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况概述

本基金《基金合同》于 2023 年 6 月 26 日生效。《基金合同》生效日的基金总份额为 437,132,092.95 份。

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。

本基金的最后运作日为 2026 年 6 月 23 日，自 2026 年 6 月 24 日起，本基金进入基金财产清算程序。

§ 4 财务报告

4.1 资产负债表（经审计）

会计主体：恒越安裕纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 23 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2026 年 6 月 23 日
资 产：	
货币资金	31,372.61
结算备付金	2,207.36
交易性金融资产	1,500,823.89
其中：债券投资	1,500,823.89
买入返售金融资产	32,000.03
资产总计	1,566,403.89
负债和净资产	
负 债：	
应付赎回款	10.81
应付管理人报酬	308.67
应付托管费	102.89
应交税费	26.01
负债合计	448.38
净资产：	
实收基金	1,445,283.82
未分配利润	120,671.69
净资产合计	1,565,955.51
负债和净资产总计	1,566,403.89

注：1、本清算报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《恒越安裕纯债债券型证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。于本基金最后运作日，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

2、报告截止日 2026 年 6 月 23 日(基金最后运作日)，恒越安裕纯债债券型证券投资基金单位净值为 1.0835 元，基金份额为 1,445,283.82 份。

3、货币资金 31,372.61 元，包括了本基金存放于托管人账户内的存款 30,366.30 元（含账户应计利息）和基金结算机构的证券账户内存款 1,006.31 元（含账户应计利息）。

4、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，注册会计师施翊洲、管嫣婷签字出具了安永华明（2026）专字第 80015803_B03 号标准无保留意见的审计报告。

§ 5 清算情况

自 2026 年 6 月 24 日至 2026 年 7 月 8 日止（即清算期间），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 2026 年 6 月 23 日（基金最后运作日）交易所交易性金融资产市值为 1,500,823.89 元，已于 2026 年 7 月 8 日收回至证券资金账户。

5.1.2 本基金 2026 年 6 月 23 日（基金最后运作日）结算备付金金额为 2,207.36 元，已于 2026 年 7 月 3 日前收回至基金托管账户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金 2026 年 6 月 23 日（基金最后运作日）应付赎回款 10.81 元，已于 2026 年 6 月 24 日支付。

5.2.2 本基金 2026 年 6 月 23 日（基金最后运作日）已计提的应付管理人报酬 308.67 元、应付托管费 102.89 元，已于 2026 年 7 月 2 日支付。

5.2.3 本基金 2026 年 6 月 23 日（基金最后运作日）应交税费为 26.01 元，已于 2026 年 7 月 8 日支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2026 年 6 月 24 日 至 2026 年 7 月 8 日止 清算期间
一、收入	956.51
1、利息收入	53.17
其中：银行存款、结算备付金和存出保证金产生的利息收入	2.54
2、投资收益	2,562.82

项目	自 2026 年 6 月 24 日 至 2026 年 7 月 8 日止 清算期间
3、公允价值变动损益	-1,659.48
二、费用	1.8
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	954.71

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 2026 年 6 月 23 日基金净资产	1,565,955.51
加：清算期间净收益	954.71
加：清算期间收到申购款	-
减：清算期间支付赎回、转出款（含费用）	217.1
二、2026 年 7 月 8 日基金净资产	1,566,693.12

根据本基金的《基金合同》，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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

自 2026 年 7 月 9 日(清算期结束日次日)至清算款划出日前一日的银行存款利息、结算备付金利息亦属基金份额持有人所有，按实际适用的利率计算。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未到账利息款项（该金额可能与实际到账利息金额存在略微差异），垫付利息与实际到账利息的差额由管理人承担。

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。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规的规定及《基金合同》的约定及时进行分析。

§ 6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

1、恒越安裕纯债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恒越安裕纯债债券型证券投资基金清算事宜之法律意见

6.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址：上海市浦东新区龙阳路 2277 号 21 楼。

6.3 查阅方式

投资者可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。

恒越安裕纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组