

华商回报 1 号混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：华商基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告出具日期：2020 年 12 月 8 日

报告公告日期：2020 年 12 月 15 日

§ 1 重要提示

华商回报 1 号混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由华商保本 1 号混合型证券投资基金于 2018 年 6 月 1 日起转型而成。华商保本 1 号混合型证券投资基金经中国证监会《关于准予华商保本 1 号混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]565 号）准予注册，于 2016 年 5 月 17 日成立。本基金基金管理人为华商基金管理有限公司，本基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据市场环境的变化和基金运作情况，为保护基金份额持有人利益，基金管理人根据《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》和《华商回报 1 号混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，经与本基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会（以下简称“本次基金份额持有人大会”），审议《关于终止华商回报 1 号混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于 2020 年 11 月 23 日表决通过了《关于终止华商回报 1 号混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。基金管理人于 2020 年 11 月 24 日发布《关于华商回报 1 号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的公告》（以下简称“决议生效公告”）。根据决议生效公告，2020 年 11 月 24 日是本基金的最后运作日，自 2020 年 11 月 25 日起，本基金进入清算程序。

基金管理人华商基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰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，并由普华永道中天会计师事务所（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	华商回报 1 号混合
基金主代码	002596
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日	2018 年 6 月 1 日
基金最后运作日（2020 年 11 月 24 日）份额总额	81,064,503.68
投资目标	在力争本金稳妥的基础上，适当参与股票投资，在合理控制风险、保障基金资产流动性的前提下，力求持续高效地获取稳健回报。
投资策略	本基金的大类资产配置主要通过分析宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间债券市场、股票市场的相对收益率，主动调整债券、股票类资产在给定区间内的动态配置，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化投资组合。具体投资策略详见基金合同。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率×60%+沪深 300 指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。
基金管理人	华商基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况

华商回报 1 号混合型证券投资基金由华商保本 1 号混合型证券投资基金转型而成。

2016 年 3 月 18 日，华商保本 1 号混合型证券投资基金经中国证监会《关于准予华商保本 1 号混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]565 号）准予注册，基金管理人为华商基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股

份有限公司。华商保本 1 号混合型证券投资基金自 2016 年 4 月 20 日至 2016 年 5 月 12 日进行公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续,《华商保本 1 号混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 5 月 17 日生效。

根据《华商保本 1 号混合型证券投资基金基金合同》的约定,保本周期届满时,若华商保本 1 号混合型证券投资基金未能符合保本基金存续条件,则转型为非保本的混合型证券投资基金,基金名称相应变更为“华商回报 1 号混合型证券投资基金”。华商保本 1 号混合型证券投资基金第一个保本周期到期日为 2018 年 5 月 17 日,第一个保本周期到期后,华商保本 1 号混合型证券投资基金不符合保本基金的存续条件,自 2018 年 6 月 1 日起华商保本 1 号混合型证券投资基金转型为华商回报 1 号混合型证券投资基金,《华商回报 1 号混合型证券投资基金基金合同》自该日起生效。

自 2018 年 6 月 1 日至 2020 年 11 月 24 日期间,本基金按《基金合同》正常运作。本基金以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会,并于 2020 年 11 月 23 日计票,本次基金份额持有人大会表决通过了《关于终止华商回报 1 号混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》(以下简称“《议案》”)。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》、《基金合同》以及上述经基金份额持有人大会表决通过的《议案》的有关规定,本基金自 2020 年 11 月 25 日起进入财产清算期。

§ 4 财务会计报告(经审计)

基金最后运作日资产负债表

会计主体: 华商回报 1 号混合型证券投资基金

报告截止日: 2020 年 11 月 24 日(基金最后运作日)

单位: 人民币元

资 产	基金最后运作日(2020 年 11 月 24 日)
资 产:	
银行存款	3,639,651.88
结算备付金	2,063,004.09

存出保证金	2,505.37
交易性金融资产	630,000.00
应收证券清算款	37,256,111.18
应收利息	8,269.40
资产总计	43,599,541.92
负债和所有者权益	基金最后运作日（2020年11月24日）
负 债：	
应付赎回款	2,854.90
应付管理人报酬	43,083.11
应付托管费	7,180.54
应付交易费用	195.00
其他负债	130,899.01
负债合计	184,212.56
所有者权益：	
实收基金	81,064,503.68
未分配利润	-37,649,174.32
所有者权益合计	43,415,329.36
负债和所有者权益总计	43,599,541.92

注：1、基金最后运作日 2020 年 11 月 24 日，基金份额总额为 81,064,503.68 份。基金份额净值为 0.5356 元。

2、本基金财务报表按照中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华商回报 1 号混合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以及中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定和允许的基金行业实务操作编制。

§ 5 清算情况说明

自 2020 年 11 月 25 日至 2020 年 12 月 8 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 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用。按照《基金合同》的规定清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支

付。

5.2 资产处置情况

1、本基金最后运作日结算备付金为 2,063,004.09 元，其中 843,956.47 元已于 2020 年 12 月 2 日划回本基金托管账户。为加快清盘速度，基金管理人将以自有资金垫付尚未返还的结算备付金。

2、本基金最后运作日存出保证金为 2,505.37 元，该款项已于 2020 年 12 月 2 日归还至本基金托管账户。

3、本基金最后运作日持有交易性金融资产 630,000.00 元，为交易性债券资产，已于 2020 年 11 月 27 日完成变现。

4、本基金最后运作日应收证券清算款为 37,256,111.18 元，该款项已于 2020 年 11 月 25 日划回本基金托管账户。

5、本基金最后运作日应收利息为 8,269.40 元，其中包括应收银行存款利息 6,079.21 元、应收结算备付金利息 2,184.74 元和应收存出保证金利息 5.45 元，为加快清盘速度，基金管理人将以自有资金垫付上述未结应收利息。

5.3 负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付赎回款为 2,854.90 元，已于 2020 年 11 月 25 日和 2020 年 11 月 26 日从本基金托管账户划付给基金份额持有人。

2、本基金最后运作日应付管理人报酬为 43,083.11 元，该款项已于 2020 年 11 月 25 日从本基金托管账户支付。

3、本基金最后运作日应付托管费为人民币 7,180.54 元，该款项已于 2020 年 11 月 25 日从本基金托管账户支付。

4、本基金最后运作日应付交易费用为 195.00 元，其中包括中央国债登记结算有限责任公司债券结算服务费 150.00 元和中国外汇交易中心交易手续费 45 元，上述款项已分别于 2020 年 11 月 26 日、2020 年 11 月 27 日从本基金托管账户支付。

5、本基金最后运作日其他负债为人民币 130,899.01 元，包括以下内容：

①应付赎回费为人民币 4.77 元，已于 2020 年 11 月 25 日和 2020 年 11 月

26 日从本基金托管账户支付；

②应付 2020 年报社信息披露费 71,694.24 元，已于 2020 年 11 月 25 日从本基金托管账户支付；

③应付中央国债登记结算有限责任公司账户维护费 3,000.00 元，应付银行间市场清算所股份有限公司账户维护费 3,000.00 元和查询服务费 200.00 元，均已于 2020 年 11 月 26 日从本基金托管账户支付；

④应付清盘审计费 53,000.00 元，已于 2020 年 11 月 26 日从本基金托管账户支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2020 年 11 月 25 日 至 2020 年 12 月 8 日止清算期间
一、清算收益	
利息收入（注 1）	8,791.75
债券变现损益（注 2）	169,999.20
赎回费收入（注 3）	3.54
清算收入小计	178,794.49
二、清算费用	
银行汇划费（注 4）	83.00
清算费用小计	83.00
三、清算净收益	178,711.49

注：1. 利息收入包括本基金计提的自 2020 年 11 月 25 日至 2020 年 12 月 8 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，以及直销申购款结息产生的利息收入；

2. 债券变现损益系本次清算期间，债券资产卖出变现金额扣减交易手续费后的余额与基金最后运作日债券资产账面余额的差额；

3. 赎回费收入系于 2020 年 11 月 25 日确认的投资者赎回申请产生的归属于基金资产的赎回费收入。

4. 银行汇划费是清算期间产品划付款项所产生的银行划款手续费。按照《基金合同》的约定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5.5 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	
一、最后运作日 2020 年 11 月 24 日基金净资产	43,415,329.36
加：清算期间净收益	178,711.49
减：基金净赎回金额（于 2020 年 11 月 25 日确认的投资者申购赎回申请，含赎回费）	306,709.70
二、2020 年 12 月 8 日基金净资产	43,287,331.15

截至本次清算期结束日 2020 年 12 月 8 日，本基金剩余财产为人民币 43,287,331.15 元，根据本基金的《基金合同》约定，基金财产清算小组将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财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。

2020 年 12 月 9 日至清算款划出日前一日银行存款、结算备付金产生的应收利息亦属份额持有人所有。以上利息均按实际适用的利率计算。

截至 2020 年 12 月 8 日，本基金结算备付金余额为 1,219,047.62 元，应收利息为 14,961.22 元（以当前适用的利率预估），为加快清盘速度，上述款项以及 2020 年 12 月 9 日至清算款划出日前一日银行存款、结算备付金产生的应收利息将由基金管理人以自有资金垫付。基金管理人垫付的资金将于清算款划出日前划入托管账户，垫付资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

5.6 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、基金合同等规定及时分配。

§ 6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

1. 《华商回报 1 号混合型证券投资基金审计报告》;
2. 《上海源泰律师事务所关于华商回报 1 号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、基金托管人处。

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人的办公场所免费查阅。

基金管理人办公地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人华商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：4007008880（免长途费），010-58573300

基金管理人网址：<http://www.hsfund.com>

华商回报 1 号混合型证券投资基金
基金财产清算小组

2020 年 12 月 8 日