

# 浙商智多益稳健一年持有期混合型 证券投资基金

## 清算报告

基金管理人：浙商基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

清算报告出具日：2022年11月3日

清算报告公告日：2022年12月7日

## 目录

|               |    |
|---------------|----|
| 重要提示.....     | 3  |
| 一、基金概况.....   | 4  |
| 二、基金运作情况..... | 4  |
| 三、财务会计报告..... | 6  |
| 四、清算情况.....   | 7  |
| 五、备查文件.....   | 10 |

## 重要提示

浙商智多益稳健一年持有期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证监许可【2020】955号准予注册，于2021年1月29日起基金合同生效，基金管理人为浙商基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

浙商智多益稳健一年持有期混合型证券投资基金基金份额持有人大会于2022年8月25日表决通过了《关于终止浙商智多益稳健一年持有期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的表决结果及决议生效的公告详见2022年8月26日刊登在《中国证券报》和基金管理人网站上的《浙商智多益稳健一年持有期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》。

根据持有人大会通过的决议，本基金于2022年8月26日进入基金选择期，选择期间基金管理人开放赎回、转换转出等业务，本基金自2022年9月26日起进入基金财产清算程序，由基金管理人、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2022年9月26日成立基金财产清算小组，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事宜出具法律意见。

## 一、基金概况

|         |  |
|---------|--|
| 基金名称    | 浙商智多益稳健一年持有期混合型证券投资基金  |
| 基金简称    | 浙商智多益稳健一年持有期   |
| 基金代码    | A类基金份额：009677 C类基金份额：009678  |
| 基金运作方式  | 契约型开放式，锁定持有期为1年，锁定持有期到期后进入开放持有期  |
| 基金合同生效日 | 2021年1月29日   |
| 基金管理人   | 浙商基金管理有限公司   |
| 基金托管人   | 平安银行股份有限公司   |
| 注册登记机构  | 浙商基金管理有限公司   |
| 投资目标    | 基于基金管理人对市场机会的判断，灵活应用多种稳健回报策略，在严格的风险管理下，追求基金资产长期持续稳定的绝对回报。  |
| 投资策略    | 本基金采用多策略，力争实现基金资产长期持续稳定的稳健回报。  |
| 业绩比较基准  | 沪深300指数收益率×12%+恒生指数收益率×3%+中债综合全价指数收益率×75%+一年期人民币定期存款基准利率(税后)×10%                                     |
| 风险收益特征  | 本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金、货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资于港股通标的股票，需面临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。 |

## 二、基金运作情况

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可【2020】955号准予注册，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于2020年11月18日起至2021年1月26日期间向社会公开募集。本基金基金合同于2021年1月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为206,032,199.25份（含募集期间利息结转的份额）。自2021年1月29日至2022年9月25日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

因为市场环境变化，本基金规模存量较小，为保护基金份额持有人的利益，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》、本基金基金合同等有关规定，并经与本基金托管人协商一致，公司提议召开基金份额持有人大会对终止《基金合同》并进行基金财产清算事宜进行审议。基金管理人已就该

事项于 2022 年 6 月 10 日向证监会报备，提议召开基金份额持有人大会终止浙商智多益稳健一年持有期混合型证券投资基金的基金合同，于 2022 年 7 月 25 日发布《浙商基金管理有限公司关于以通讯方式召开浙商智多益稳健一年持有期混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，并于 2022 年 8 月 25 日表决通过了《关于终止浙商智多益稳健一年持有期混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本基金于 2022 年 8 月 26 日进入基金选择期，选择期间基金管理人开放赎回、转换转出等业务，本基金自 2022 年 9 月 26 日起进入基金财产清算程序。

### 三、财务会计报告

(一) 基金最后运作日资产负债表 (已经审计)

会计主体: 浙商智多益稳健一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日: 2022年9月25日 (基金最后运作日)

单位: 人民币元

|               | 最后运作日<br>2022年9月25日 |
|---------------|---------------------|
| <b>资产:</b>    |                     |
| 银行存款          | 634,415.27          |
| 结算备付金         | 537,077.32          |
| 存出保证金         | 6,471.44            |
| 交易性金融资产       | 8,075,881.64        |
| 其中: 债券投资      | 8,075,881.64        |
| 买入返售金融资产      | 2,000,000.00        |
| 应收证券清算款       | 286.03              |
| 资产总计          | 11,254,131.70       |
| <b>负债:</b>    |                     |
| 应付赎回款         | 294,070.59          |
| 应付管理人报酬       | 12,454.15           |
| 应付托管费         | 1,245.41            |
| 应付销售服务费       | 801.71              |
| 其他负债          | 12,575.00           |
| 负债合计          | 321,146.86          |
| <b>所有者权益:</b> |                     |
| 实收基金          | 10,813,979.02       |
| 未分配利润         | 119,005.82          |
| 所有者权益合计       | 10,932,984.84       |
| 负债和所有者权益总计    | 11,254,131.70       |

注1：报告截止日2022年9月25日（基金最后运作日），浙商智多益稳健一年持有期A的基金份额净值为人民币1.0116元，基金份额为8,238,604.61份，浙商智多益稳健一年持有期C的基金份额净值为人民币1.0091元，基金份额为2,575,374.41份，总份额合计10,813,979.02份。

注2：本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。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，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

## 四、清算情况

自2022年9月26日起至2022年11月2日止的清算期间，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：

### （一）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，包括支付给会计师事务所、律师事务所的费用，分配基金剩余财产的手续费等，根据基金合同的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。考虑到基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算费用中的清算审计费、清算律师费由基金管理人承担。

### （二）资产清算情况

1、本基金最后运作日银行存款为人民币634,415.27元，其中含银行活期存款为人民币634,381.47元，应计银行活期存款利息为人民币33.80元。

2、本基金最后运作日结算备付金为人民币537,077.32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为人民币536,956.52元，该款项已于2022年11月2日全部收回，应计上海结算备付金利息为人民币120.80元。

3、本基金最后运作日存出保证金为人民币6,471.44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存出保证金为人民币4,191.84元，该款项已于2022年11月2日全部收回，应计上海存出保证金利息为人民币0.95元；其中存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金为人民币2,278.15元，该款项已于2022年11月2日全部收回，应计深圳存出保证金利息为人民币0.50元。

4、本基金最后运作日持有交易性金融资产为人民币8,075,881.64元，全部为债券投资，其中应计债券利息为人民币65,481.64元。以上全部交易性金融资产于2022年9月26日全部变卖出，并于2022年9月27日到账人民币8,076,386.85元。

5、本基金最后运作日持有买入返售金融资产为人民币 2,000,000.00 元。以上全部买入返售金融资产于 2022 年 9 月 27 日完成变现，变现金额为人民币 2,000,100.55 元，已全部收回。

6、本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 286.03 元，已于 2022 年 9 月 26 日划入托管账户。

(三) 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 12,454.15 元，该款项已于 2022 年 10 月 11 日支付。

2、本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,245.41 元，该款项已于 2022 年 10 月 11 日支付。

3、本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 801.71 元，该款项已于 2022 年 10 月 11 日支付。

4、本基金最后运作日应付赎回款为人民币 294,070.59 元，该款项已分别于 2022 年 9 月 26 日、2022 年 9 月 27 日支付。

5、本基金最后运作日其他负债为人民币 12,575.00 元，其中应付交易费用为 175.00 元，预提上清所账户服务费为人民币 6,000.00 元，预提中债账户维护费为人民币 6,000.00 元，预提上清所查询费为人民币 400.00 元。以上款项已于 2022 年 10 月 18 日支付，其中预提的 2022 年 10 月份的上清所账户维护费 1,500.00 元、中债账户维护费 1,500.00 元和上清所查询服务费 100.00 元已回冲产品损益。

(四) 本次清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

|             | 自 2022 年 9 月 26 日<br>至 2022 年 11 月 2 日止<br>清算期间 |
|-------------|---|
| 项目          |   |
| 一、清算收益      |   |
| 1、利息收入（注 1） | 4,478.22  |
| 2、债券利息收入    |   |
| 3、投资收益（注 2） | 1,847.43  |
| 4、公允价值变动损益  | -1,342.22                                       |
| 5、其他收入      |   |
| 清算收入小计      | 4,983.43  |
| 二、清算费用      |   |
| 1、交易费用      |   |



|            |           |
|------------|-----------|
| 2、其他费用（注3） | -3,100.00 |
| 清算费用小计     | -3,100.00 |
| 三、清算净收益    | 8,083.43  |

注1：利息收入系计提的自2022年9月26日至2022年11月2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利息收入。

注2：投资收益系清算期间持有的交易性金融资产产生的利息收入和处置产生的差价收入，同时将原计入该金融资产的公允价值变动转出至投资收益的金额。

注3：其他费用系自2022年9月26日至2022年11月2日止清算期间回冲预提10月份的中债账户维护费-1,500.00元、上清账户维护费-1,500.00元、上清账户查询服务费-100.00元。

#### （五）截至本次清算期结束日的剩余财产情况

单位：人民币元

| 项目                     | 金额            |
|------------------------|---------------|
| 一、最后运作日2022年9月25日基金净资产 | 10,932,984.84 |
| 加：清算期间净收益              | 8,083.43      |
| 减：清算期间赎回款              | 11,708.50     |
| 二、2022年11月2日基金净资产      | 10,929,359.77 |

截至本次清算期结束日2022年11月2日，本基金剩余财产为人民币10,929,359.77元。自2022年11月3日（清算期结束日次日）至清算款划出日前一日的银行存款产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注册登记机构的记录为准。基金管理人将于基金清算资金分配前对尚未结息部分予以垫资，垫资的尚未结息部分与实际结息金额的差额由管理人承担，基金管理人垫付的资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有，垫付资金及其孳生的利息将于清算结束待结息后返还给基金管理人。

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。

#### （六）基金财产清算报告的告知及剩余财产分配安排

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。

## 五、备查文件

### （一）备查文件目录

- 1、《浙商智多益稳健一年持有期混合型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《关于浙商智多益稳健一年持有期混合型证券投资基金清算事宜之法律意见》

### （二）存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

### （三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

浙商智多益稳健一年持有期混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二二年十一月三日