

蜂巢卓睿灵活配置混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人:蜂巢基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

报告出具日期: 2023 年 10 月 30 日

报告公告日期: 2023 年 10 月 31 日

一、重要提示

蜂巢卓睿灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2018 年 12 月 29 日中国证券监督管理委员会《关于准予蜂巢卓睿灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2018】2218 号）注册募集，由蜂巢基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《蜂巢卓睿灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。

根据市场环境变化，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》和《蜂巢卓睿灵活配置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，本基金基金管理人——蜂巢基金管理有限公司经与基金托管人——广发证券股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于终止蜂巢卓睿灵活配置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表决投票时间自 2023 年 9 月 25 日起，至 2023 年 10 月 20 日 17:00 止，并于 2023 年 10 月 23 日表决通过了《关于终止蜂巢卓睿灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。根据本基金基金份额持有人大会通过的议案及方案说明，自 2023 年 10 月 25 日起，本基金进入清算期。

本基金《基金合同》终止及基金财产清算安排详见 2023 年 10 月 24 日刊登在中国证监会规定媒介和基金管理人网站（<http://www.hexaamc.com>）上的《关于蜂巢卓睿灵活配置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》。

本基金清算期自 2023 年 10 月 25 日起至 2023 年 10 月 27 日止。由基金管理人蜂巢基金管理有限公司、基金托管人广发证券股份有限公司、立信会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市海华永泰律师事务所组成的基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由立信会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市海华永泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

- 1、基金名称：蜂巢卓睿灵活配置混合型证券投资基金。
- 2、基金运作方式：契约型开放式。
- 3、《基金合同》生效日：2019 年 1 月 30 日。

4、投资目标：本基金通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

5、主要投资策略：

在资产配置策略方面，本基金通过深入的基本面研究和定量分析，基于对宏观经济运行状况、货币政策、利率走势和证券市场政策分析等宏观基本面研究，结合对各大类资产的预期收益率、波动性及流动性等因素的评估，合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例。基金的股票投资组合比例将按照沪深 300 指数 PE(TTM)估值水平进行调整。

在股票投资策略方面，本基金对股票的投资采用量化多因子 alpha 选股模型，并配合事件驱动策略进行股票的筛选。在纪律化模型约束下，紧密跟踪策略，严格控制运作风险，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，从而取得稳定的超额收益。

在债券投资策略方面，本基金在债券组合的具体构造和调整上，综合运用久期管理、期限结构配置策略、债券类别配置策略、骑乘策略等组合管理手段进行日常管理。

在衍生品投资策略方面，在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货和国债期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，届时将根据风险管理原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。

在资产支持证券投资策略方面，本基金将深入分析上述基本面因素，同时综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

6、业绩比较基准：中证 800 指数收益率*55%+中证全债指数收益率*45%。

7、风险收益特征：本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

8、基金管理人：蜂巢基金管理有限公司。

9、基金托管人：广发证券股份有限公司。

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：蜂巢卓睿灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023年10月24日

单位：人民币元

资产	本期末 2023 年 10 月 24 日（基金最后运作日）
资产：	
银行存款	450,631.51
结算备付金	1,141,360.99
交易性金融资产	2,225,166.90
买入返售金融资产	2,490,002.49
资产总计	6,307,161.89
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	113,881.39
应付管理人报酬	6,117.65
应付托管费	1,019.59
应付销售服务费	466.50
应交税费	206.24
负债合计	121,691.37
净资产：	
实收基金	7,625,963.59
未分配利润	-1,440,493.07
所有者权益合计	6,185,470.52
负债和所有者权益总计	6,307,161.89

注：报告截止日 2023 年 10 月 24 日（基金最后运作日），基金份额总额 7,625,963.59 份。其中蜂巢卓睿混合 A 基金份额净值 0.8149 元，基金份额总额 5,912,889.15 份；蜂巢卓睿混合 C 基金份额净值 0.7979 元，基金份额总额 1,713,074.44 份。

四、清盘事项说明

1、清算原因

本基金基金份额持有人大会于 2023 年 10 月 23 日表决通过了《关于终止蜂巢卓睿灵活配置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。

2、清算起始日

根据《关于蜂巢卓睿灵活配置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》，本基金自 2023 年 10 月 25 日起进入清算程序。

3、清算报表编制基础

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《资产管理产品相关会计处理规定》的有关规定编制的。基金管理人编制清算报表是为了呈报蜂巢卓睿灵活配置混合型证券投资基金全体持有人以及中国证监会使用。因此，清算报表可能不适用于其他用途。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。

五、清算情况

自 2023 年 10 月 25 日起至 2023 年 10 月 27 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：

1、清算费用

按照《基金合同》“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”章节的规定，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，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。考虑到本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，除银行直接扣付的划款手续费外，自清算起始日起，与本基金的清算相关的清算费用均将由基金管理人代为支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为 450,631.51 元，其中包含应计利息 1,001.84 元。清算期间，银行存款共计提利息 39.11 元。截至清算期结束日，银行存款余额为 137,712.41 元，其中应计银行存款利息余额为 1,040.95 元（该款项将由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至托管账户，基金管理人垫付资金至托管账户到账日起孳生的利息归基金管理人所有）。

(2) 本基金为券商结算模式基金，最后运作日结算备付金为 1,141,360.99 元，均为广发证券券商账户内的券商保证金，应计券商保证金利息为 763.11 元。清算期间券商保证金计提利息为 137.07 元。截至清算期结束日，券商保证金为

5,839,382.22 元，券商保证金计提利息为 900.18 元（该款项将由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至托管账户，基金管理人垫付资金至托管账户到账日起孳生的利息归基金管理人所有）。

（3）本基金最后运作日持有的交易性金融资产为 2,225,166.90 元，全部为股票投资。该股票投资已于清算期间处置变现，变现产生的证券清算款为 2,207,665.86 元，已于清算期间划入券商保证金账户。

（4）本基金最后运作日买入返售金融资产为 2,490,002.49 元，全部为上交所质押式正回购。该买入返售金融资产已于清算期间到期，变现产生的证券清算款为 2,490,218.30 元，已于清算期间划入券商保证金账户。

3、 负债清偿情况

（1）本基金最后运作日应付 TA 赎回款为 113,881.39 元，其中蜂巢卓睿混合 A 的应付赎回款为 25,266.66 元，蜂巢卓睿混合 C 的应付赎回款为 88,614.73 元。本清算期间确认的最后运作日净赎回金额（不含费用）为 199,076.81 元，其中蜂巢卓睿混合 A 的净赎回金额为 92,900.55 元（另有 0.01 元赎回费单独支付），蜂巢卓睿混合 C 的净赎回金额为 106,176.26 元。应付 TA 赎回款均已于清算期支付完毕。

（2）本基金最后运作日应付管理人报酬为 6,117.65 元，该款项将于清算报告出具后支付。

（3）本基金最后运作日应付托管费为 1,019.59 元，该款项将于清算报告出具后支付。

（4）本基金最后运作日应付销售服务费为 466.50 元，该款项将于清算报告出具后支付。

（5）本基金最后运作日应交税费为 206.24 元，其中贷款服务增值税为 184.15 元，城建税附加税为 12.89 元，教育附加税为 5.52 元，地方教育附加税为 3.68 元。由于本基金最后运作日在上海交易所做了一天的隔夜正回购，产生的利息收入按照税务机关要求，需缴纳对应的增值税，故最终需缴纳贷款服务增值税为 6.29 元，城建税附加税为 0.44 元，教育附加税为 0.19 元，地方教育附加税为 0.13 元。最终应交税费合计为 213.29 元，其中贷款服务增值税为 190.44 元，城建税附加税为 13.33 元，教育附加税为 5.71 元，地方教育附加税为 3.81 元，该款项

将于清算报告出具后支付。

4、清算日的清算损益情况

单位：人民币元

	自 2023 年 10 月 25 日起 至 2023 年 10 月 27 日止的清算期间
一、清算期间收益	
利息收入（注 1）	385.70
投资收益（注 2）	-374,425.55
公允价值变动收益（注 3）	356,924.51
其他收入（注 4）	0.04
清算收入小计	-17,115.30
二、清算期间费用	
税金及附加	0.76
清算费用小计（注 5）	0.76
三、清算净收益	-17,116.06

注 1：利息收入系计提的自 2023 年 10 月 25 日至 2023 年 10 月 27 日止清算期间的银行存款利息、券商保证金利息和上交所质押式回购利息。

注 2：投资收益系清算期间股票投资卖出产生的投资收益-372,042.34 元扣除交易费用 2,383.21 元后的净额。

注 3：公允价值变动收益系清算期间股票投资的公允价值变动产生的收益。

注 4：其他收入为赎回费收入。

注 5：按照《基金合同》“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”章节的规定，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，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。考虑到本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，除银行直接扣付的划款手续费外，自清算起始日起，与本基金的清算相关的清算费用将由基金管理人代为支付。

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

蜂巢卓睿灵活配置混合型证券投资基金

项目	金额
一、最后运作日 2023 年 10 月 24 日基金净资产	6,185,470.52
加：清算期间净收益	-17,116.06

减：清算期间确认的最后运作日净赎回金额（含费用）	199,076.86
二、2023年10月27日基金资产净值	5,969,277.60

注：资产处置及负债清偿后，2023年10月27日（清算结束日）本基金剩余财产为人民币5,969,277.60元。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，按各类基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各类别基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。同一类别的基金份额持有人对基金财产清算后剩余资产具有同等的分配权。

基金管理人以自有资金垫付的资金将于清算款划出前划入托管账户，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。基金管理人垫付的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。清算期结束日后至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息属份额持有人所有，在支付清算款时将一并计算并支付给份额持有人。

6、基金财产清算报告的告知安排

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，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1)《蜂巢卓睿灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2)《上海市海华永泰律师事务所关于<蜂巢卓睿灵活配置混合型证券投资基金清算报告>之法律意见》。

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

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。

报告出具日期：2023年10月30日

报告公告日期：2023年10月31日