

浙商汇金卓越优选 3 个月持有期股票型基金中基金
(FOF)
清算报告

基金管理人：浙江浙商证券资产管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告出具日：2024年2月6日

报告公告日：2024年3月8日

§ 1 基金情况

（一）基本信息

1. 基本信息

基金名称	浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）
基金简称	浙商汇金卓越优选3个月
基金主代码	009113
基金运作方式	契约型、开放式；本基金对每份基金份额设置3个月的最短持有期限，即自基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）至该日3个月后的月度对日的期间内，投资者不能提出赎回申请；该日3个月后的月度对日之后，投资者可以提出赎回申请。如该对应日期为非工作日，则顺延至下一工作日，若该日历年中不存在对应日期的，则顺延至该月最后一日的下一工作日。
基金合同生效日	2020年05月15日
最后运作日基金份额总额	15,765,511.00份
投资目标	在合理控制风险的前提下，通过优选基金投资组合，力求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略为：首先，依据宏观预判确定基金组合风格配置方案；而后，利用基金筛选策略优选各个风格中的基金构筑投资组合。基金经理将定期及不定期对组合投资情况进行业绩归因，适时进行组合战术调整和基金品种调整。</p> <p>（一）基于宏观动态的风格配置策略； （二）基金筛选策略； （三）股票投资策略； （四）债券投资策略； （五）资产支持证券投资策略； （六）其他。</p>

业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+中债综合财富指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金中基金（FOF），其预期风险和预期收益高于混合型基金中基金（FOF）、混合型基金、债券型基金中基金（FOF）、债券型基金和货币市场型基金中基金（FOF）及货币市场基金。
基金管理人	浙江浙商证券资产管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

2. 基金运作情况

浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可[2019]2706号《关于准予浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）注册的批复》准予注册，由浙江浙商证券资产管理有限公司（以下简称“浙商资产管理公司”）作为基金管理人，中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）作为基金托管人，于2020年05月15日募集设立。本基金的募集期间为2020年4月21日至2020年5月12日止。

根据《浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）招募说明书》约定，本基金的销售对象为：符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。每份基金份额发售面值为人民币1.00元。截至2020年5月14日止，本基金首次向社会公开发售募集（扣除认购手续费后）的实收基金（本金）人民币292,511,585.10元，该基金首次发行募集的实收基金（本金）折合份额为292,511,585.10份，募集期间产生的利息折合份额为7,596.81份，共计292,519,181.91份。设立募集资金已经北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）杭州分所验资，并出具[2020]京会兴浙分验字第68000027号验资报告。

本基金类型为股票型证券投资基金、基金中基金（FOF），基金的运作方式为契约型开放式，并对每份基金份额设置3个月的最短持有期限，存续期为不定

期。基金管理人为浙江浙商证券资产管理有限公司，登记机构为浙江浙商证券资产管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

（二）清算原因

为保护基金份额持有人利益，根据市场环境的变化，本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）基金合同》的有关规定，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，提议终止《浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”），并召开基金份额持有人大会进行表决。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）基金份额持有人大会于2024年1月9日表决通过了《关于终止浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）基金合同有关事项的议案》，根据该议案的说明，在基金份额持有人大会决议生效并进入清算程序前，本基金仍按照《基金合同》约定的运作方式进行运作，该次基金份额持有人大会决议自同日起生效。本基金管理人于2024年1月10日发布《浙江浙商证券资产管理有限公司关于浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）基金份额持有人大会（二次召开）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，本基金并于2024年1月11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）和上海市通力律师事务所成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，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，由上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

（三）最后运作日及清算期间

本基金的最后运作日为2024年1月10日，清算期间为2024年1月11日至2024年2月6日。

§ 2 清算报表编制基础

本基金的清算报表是在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。由于报告性质所致，本基金的清算报表并无比较期间的相关数据列示。

§ 3 财务会计报告

3.1 资产负债表(已审计)

会计主体：浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）

报告截止日：2024年1月10日(基金最后运作日)

单位：人民币元

资产	本期末 2024 年 1 月 10 日（基金最后运作日）
资产：	
银行存款	656,033.19
结算备付金	105,073.31
存出保证金	4,951.20
交易性金融资产	11,023,512.10
其中：股票投资	446,914.00
债券投资	611,927.84
基金投资	9,964,670.26
应收申购款	34.97
应收证券清算款	409,586.78
应收利息	0.00
资产合计	12,199,191.55
负债和所有者权益：	
负债：	
卖出回购金融资产款	0.00
应付证券清算款	0.00
应付赎回款	685,037.97
应付赎回费	569.34

应付管理人报酬	3,405.36
应付托管费	681.07
应付销售服务费	0.00
应付交易费用	3,145.60
应交税费	0.00
应付利息	0.00
预提费用	22,600.00
其他负债	10,000.00
负债合计	725,439.34
所有者权益：	
实收基金	15,765,511.00
未分配利润	-4,291,758.79
所有者权益合计	11,473,752.21
负债和所有者权益总计	12,199,191.55

注：报告截止日2024年1月10日（基金最后运作日），基金份额净值0.7278元，基金份额总额15,765,511.00份。

§ 4 清算情况

自2024年1月11日至2024年2月6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：

4.1 资产处置情况

4.1.1 本基金最后运作日银行存款余额656,033.19元，其中包含应计利息332.42元，为存放于中国农业银行股份有限公司的活期存款。银行存款应计利息由基金管理人先行垫付，待结息日返回给基金管理人。

4.1.2 本基金最后运作日存出保证金金额4,951.20元，其中包含应计利息3.19元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金。存出保证金及其应计利息由基金管理人先行垫付，待全部调整至托管户并结息后返还给基金管理人。

4.1.3 本基金最后运作日结算备付金金额105,073.31元，其中包含应计利息33.57元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金。结算备付金金

额预计于2024年2月8日调整为165.73元，结算备付金由基金管理人先行垫付，待全部调整至托管账户后返还给基金管理人。结算备付金应计利息由基金管理人先行垫付，待结息日返还给基金管理人。

4.1.4 本基金最后运作日交易性金融资产11,023,512.10元，为了保护基金份额持有人利益，上述交易性金融资产已于2024年2月1日前全部卖出，扣除交易费用后的变现金额为人民币10,930,318.65元。

4.1.5 本基金最后运作日应收申购款34.97元。该款项已于2024年1月11日划入托管账户。

4.1.6 本基金最后运作日应收证券清算款409,586.78元。该款项已于2024年1月12日划入托管帐户。

4.2 负债清偿情况

4.2.1 本基金最后运作日应付管理人报酬3,405.36元，该款项已于2024年2月2日支付。

4.2.2 本基金最后运作日应付托管费681.07元，该款项已于2024年2月2日支付。

4.2.3 本基金最后运作日应付交易费用3,145.60元，该款项已于2024年2月2日支付。

4.2.4 本基金最后运作日预提费用22,600.00元，为2023年年度审计费与产品清算审计费，年度审计费已于2024年2月1日冲销，产品清算审计费已于2024年2月5日付清。

4.2.5 本基金最后运作日其他应付款10,000.00元，为律师费，该款项已于2024年1月12日付清。

4.2.6 本基金最后运作日应付赎回款685,037.97元，该款项已于2024年1月12日付清。

4.2.7 本基金最后运作日应付赎回费569.34元，该款项已于2024年1月12日付清。

4.3 清算期间（2024年1月11日至2024年2月6日）清算损益情况

4.3.1 清算期间的利息收入金额3,912.81元,包括计提的清算期间的存款利息收入、结算备付金利息收入、存出保证金利息收入。

4.3.2 清算期间的投资收益金额-1,542,963.47元,系本基金最后运作日持有的交易性金融资产变现所得,卖出的同时产生交易费用4,255.78元。

4.3.3 清算期间产生的公允价值变动损益金额1,454,025.80元,系本基金股票、债券、基金投资估值增值额。

4.3.4 清算期间产生其他收入金额6.36元,系赎回费收入。

4.3.5清算期间冲销其他费用19,000.00元,系冲销年度审计费用。

4.3.6清算期间产生其他费用480.00元,系账户汇划费用。

4.4 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 2024 年 1 月 10 日基金净资产	11,473,752.21
加:申购款	9.99
减:赎回款	739,159.17
加:清算期间净收益	-70,754.28
二、2024 年 2 月 6 日基金净资产	10,663,848.75

根据《基金合同》约定,依据基金财产清算的分配方案,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。

资产处置及负债清偿后,本基金截至2024年2月6日止的剩余净资产为10,663,848.75元。

截至2024年2月6日止,经基金管理人以及基金托管人确认,本基金托管账户银行存款余额共计人民币10,552,442.11元(含应计利息4,111.50元),存出保证金6,435.89元(含应计利息9.48元),清算备付金105,200.75元(含应计利息161.01元),其他应付款230.00元。清算结束日次日(2024年2月7日)至清算资

金划出前一日银行存款利息、备付金利息、保证金利息亦属基金份额持有人所有。清算过程中各项利息及费用与实际结算金额的尾差由基金管理人承担。

4.5 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。

§ 5 备查文件

5.1 备查文件目录

- 5.1.1 《浙商汇金卓越优选 3 个月持有期股票型基金中基金（FOF）清算审计报告》
- 5.1.2 《上海市通力律师事务所关于〈浙商汇金卓越优选 3 个月持有期股票型基金中基金（FOF）清算报告〉的法律意见》

5.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

5.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）基金财产清算小组

2024年3月8日