

博远双债增利混合型证券投资基金

清算报告

基金管理人:博远基金管理有限公司

基金托管人:招商证券股份有限公司

清算报告出具日:二〇二五年一月十七日

清算报告公告日:二〇二五年一月二十二日

一、重要提示

博远双债增利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] 129号文注册募集,《博远双债增利混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)于2020年4月15日正式生效。本基金的基金管理人为博远基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”),基金托管人为招商证券股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。

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《基金合同》的有关规定,本基金基金管理人经与基金托管人协商一致决定召开基金份额持有人大会,讨论并审议《关于博远双债增利混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》。

本次基金份额持有人大会的权益登记日为2024年11月13日,会议投票表决时间为自2024年11月14日起,至2024年12月9日17:00止(投票表决时间以基金管理人收到表决票时间为准),并于2024年12月10日表决通过了《关于博远双债增利混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》。

根据基金管理人于2024年12月11日发布的《关于博远双债增利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公告》,本基金自2024年12月12日起进入清算程序,由基金管理人、基金托管人、容诚会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2024年12月12日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由容诚会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,由上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

基金名称	博远双债增利混合型证券投资基金
基金简称	博远双债增利混合
基金主代码	009111
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年4月15日
最后运作日(2024年12月11日) 基金份额总额	2,125,365.07份
投资目标	本基金依托管理人的投研平台精选优质可转换债券和信用债品种,在严格控制组合风险并保

	持良好流动性的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者创造长期稳定的回报。	
投资策略	本基金一方面基于对宏观经济、政策趋向、市场环境及各类资产市场流动性等因素的综合分析，动态调整基金资产中各类资产的配置比例；一方面依附基金管理人投研平台和外部机构投研支持重点投资可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券和信用债品种。整体投资在严格控制投资组合风险的前提下，运用多种积极资产增值策略，实现本基金的投资目标。	
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×40%+中债信用债总指数收益率×40%+沪深300指数收益率×15%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	
基金管理人	博远基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博远双债增利混合A	博远双增利混合C
下属分级基金的交易代码	009111	009112
最后运作日(2024年12月11日) 下属分级基金的份额总额	479,227.95份	1,646,137.12份

三、基金运作情况说明

本基金《基金合同》于2020年4月15日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为237,417,214.48份基金份额，其中认购资金利息折合24,578.86份基金份额。自2020年4月15日至2024年12月11日期间，本基金按《基金合同》约定正常运作。

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《基金合同》的有关规定，本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致决定召开基金份额持有人大会，讨论并审议《关于博远双债增利混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》。

本次基金份额持有人大会的权益登记日为2024年11月13日，会议投票表决时间为自2024年11月14日起，至2024年12月9日17:00止（投票表决时间以基金管理人收到表决票时间为准）。并于2024年12月10日表决通过了《关于博远双债增利混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》。本基金最后运作日为2024年12月11日，根据基金管理人于2024年12月11日发布的《关于博远双债增利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公告》，本基金自2024年12月12日起进入清算程序。

四、财务会计报告

4.1 资产负债表（已经审计）

会计主体：博远双债增利混合型证券投资基金

报告截止日：2024年12月11日

单位：人民币元

资产	基金最后运作日 2024年12月11日
资产：	
货币资金	286,178.28
存出保证金	293,662.13
交易性金融资产	1,556,042.14
其中：股票投资	38,570.00
其中：债券投资	1,517,472.14
应收申购款	719.99
资产总计	2,136,602.54
负债：	
应付赎回款	6,278.36
应付管理人报酬	1,056.33
应付托管费	226.37
应付销售服务费	243.20
应交税费	38.37
其他负债	10,000.00
负债合计	17,842.63
净资产：	
实收基金	2,125,365.07

未分配利润	-6,605.16
净资产合计	2,118,759.91
负债和净资产总计	2,136,602.54

注：1、本基金最后运作日2024年12月11日，基金份额总额2,125,365.07份，其中博远双债增利混合A基金份额479,227.95份，基金份额净值1.0041元；博远双债增利混合C基金份额1,646,137.12份，基金份额净值0.9948元。

2、本财务报告已经容诚会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。

五、清算情况

自2024年12月12日至2025年1月17日止为清算期间，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

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”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财产中支付。

5.2 资产处置情况

5.2.1 本基金最后运作日货币资金为人民币286,178.28元，其中托管户活期银行存款为人民币285,146.81元，应计活期银行存款利息为人民币1,031.47元，于清算期2024年12月23日结息至托管账户。

5.2.2 本基金最后运作日存出保证金人民币293,662.13元，其中存放于广发证券股份有限公司的存出保证金为人民币293,258.89元，2024年12月16日已划回托管户；应计存出保证金利息为人民币403.24元，于清算期2024年12月19日实际结息并划回托管账户。

5.2.3 本基金最后运作日交易性金融资产为股票资产以及债券资产。股票资产市值为人民币38,570.00元，该部分股票资产于清算期2024年12月13日已全部完成变现；债券资产市值为人民币1,517,472.14元，该部分债券资产于清算期间2024年12月12日至2024年12月13日已全部完成变现。

5.2.4 本基金最后运作日应收申购款为人民币719.99元，该应收款项于清算期2024年12月12日划至托管账户。

5.2.5 本基金最后运作日，本基金申购申请合计人民币409.83元，已于清算期2024年12月12日确认并于清算期2024年12月13日划至托管账户。

5.3 负债清偿情况

5.3.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币6,278.36元，该应付款项于清算期2024年12月12日支付。

5.3.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币1,056.33元，该应付款项于清算期2024年12月17日支付。

5.3.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币226.37元，该应付款项于清算期2024年12月17日支付。

5.3.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币243.20元，该应付款项于清算期2024年12月17日支付。

5.3.5 本基金最后运作日应交税费为人民币38.37元，该应付款项于清算期2024年12月17日支付。

5.3.6 本基金最后运作日，本基金赎回申请合计367,843.17份，已于清算期2024年12月12日确认并于清算期2024年12月13日支付赎回款。

5.3.7 本基金最后运作日其他负债为基金预提清算审计费，费用金额为人民币10,000.00元，该款项于清算期结束后安排支付至容诚会计师事务所（特殊普通合伙）。本基金因清算事项产生应支付给上海市通力律师事务所的律师费，在清算期间预提律师费人民币12,000.00元，该款项于清算期结束后安排支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2024年12月12日-2025年1月17日 (本次清算期截止日)
一、清算收益	5,141.98
1、利息收入-活期银行存款利息及证券资金户利息收入（注 1）	2,471.11
2、投资变现损益（损失以“-”填列）	2,670.72
其中：股票投资变现损益（注 2）	116.23

债券投资变现损益（注 3）	2,554.49
3、其他收入（注 4）	0.15
减：二、清算费用	12,000.31
1、税金及附加（注 5）	0.31
2、其他费用（注 6）	12,000.00
三、清算净收益	-6,858.33

注：

1、存款利息收入系以当前适用的利率预估计提的清算期间的利息收入，各类基金份额之间的收益分配按照各类别净值占比进行分配，其中由托管账户产生的活期银行存款利息收入为人民币2,422.43元，系自2024年12月12日至2025年1月17日止清算期间的活期银行存款利息收入，银行存款利息收入如截至划付清算款前一日仍有未结息到账部分将由基金管理人以自有资金先行垫付，垫付资金将于划付清算款前划入本基金托管账户；由广发证券资金账户产生的利息收入为人民币48.68元，系自2024年12月12日至2024年12月18日清算期间的资金账户利息收入，于2024年12月19日实际结息并划回托管账户。

2、股票投资变现损益系本次清算期间股票资产处置变现损益，扣除处置过程中发生的交易费用，各类基金份额之间的收益分配按照各类别净值占比进行分配。

3、债券投资变现损益系本次清算期间债券资产处置变现损益，扣除处置过程中发生的交易费用，各类基金份额之间的收益分配按照各类别净值占比进行分配。

4、其他收入系清算期间2024年12月12日确认的基金赎回费收入。

5、税金及附加系清算期间产生的增值税及附加税费用。

6、其他费用为清算涉及的律师费用，金额为人民币12,000.00元，该款项于清算期结束后安排支付至上海市通力律师事务所。

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	金额
一、2024年12月11日(最后运作日)基金净资产	2,118,759.91
二、清算期间基金份额交易产生的基金净值变动数	-365,696.12

其中：基金份额申购增加的净资产（2024年12月12日确认的投资者申购申请）	409.83
基金份额赎回减少的净资产（2024年12月12日确认的投资者赎回申请）	-366,105.95
三、清算期间净收益(净亏损用负号表示)	-6,858.33
四、2025年1月17日（清算截止日）基金净资产	1,746,205.46

注：截至本次清算期结束日2025年1月17日，本基金剩余财产为人民币1,746,205.46元。将根据本基金《基金合同》约定，依据基金财产清算的分配方案，按各类基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

自2025年1月18日至清算分配款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清算速度，基金管理人将以自有资金先行垫付尚未收回的应计银行存款利息供清算分配使用，该金额可能与实际结息金额存在略微差异，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。

5.6 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，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件

6.1 备查文件目录

- 1、博远双债增利混合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<博远双债增利混合型证券投资基金清算报告>的法律意见》。

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 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。

博远双债增利混合型证券投资基金
基金财产清算小组

二〇二五年一月十七日