

# 浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金 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：中国光大银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二一年九月三十日

清算报告公告日：二〇二一年十月二十一日

## § 1 重要提示

浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]900号《关于准予浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》批准,由浙江浙商证券资产管理有限公司依照《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《浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)向社会公开发行募集。《基金合同》于2018年8月6日正式生效,《基金合同》生效日的基金份额总额为280,020,032.95份,其中A类基金份额总额214,021,509.23份,C类基金份额总额65,998,523.72份,相关募集情况经北京兴华会计师事务所[2018]京会兴浙分验字第68000016号验资报告予以验证。本基金为契约型、定期开放式基金,存续期限不定。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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定:“……同时基金合同生效后,在任一开放期的最后一个开放日日终(登记机构完成最后一个开放日申购、赎回业务申请的确认以后),如发生以下情形之一的,则无须召开基金份额持有人大会……:1、基金份额持有人数量不满200人;2、基金资产净值低于5000万元。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。”本基金第三个开放期自2021年8月27日起至2021年9月2日止,登记机构完成最后一个开放日申购、赎回业务申请的确认日期为2021年9月3日。截至2021年9月3日,本基金资产净值不足5000万元。为维护基金份额持有人的利益,根据《基金合同》有关规定,本基金将终止并依据基金财产清算程序进行财产清算,无须召开持有人大会。具体情况详见2021年9月4日刊登在规定媒介上的《浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》,本基金的最后运作日为2021年9月3日。自2021年9月4日起,本基金进入清算程序。

基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司、基金托管人中国光大银行股份有限公司、北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于

2021年9月6日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

## § 2 基金产品概况

基金名称	浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	浙商汇金聚禄一年定期	
基金主代码	005423	
基金运作方式	契约型、定期开放式	
基金合同生效日	2018年8月6日	
投资目标	本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	<p>(一) 封闭期投资策略</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、资产配置策略</li> <li>2、债券投资组合策略</li> <li>3、债券投资策略</li> <li>4、国债期货投资策略</li> </ol> <p>(二) 开放期投资策略</p> <p>开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。</p>	
业绩比较基准	中债综合全价指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	浙江浙商证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
基金登记机构	浙江浙商证券资产管理有限公司	
下属分级基金的基金简称	浙商汇金聚禄一年定期A	浙商汇金聚禄一年定期C
下属分级基金的交易代码	005423	005424

### § 3 财务会计报告

#### 3.1 资产负债表(已审计)

会计主体：浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021年9月3日(基金最后运作日)

单位：人民币元

资产	本期末 2021年9月3日 (基金最后运作日)	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	87,334,445.48	11,175,719.15
结算备付金	2,041,357.12	1,827,673.13
存出保证金	6,464.07	40,432.65
交易性金融资产	61,808,212.87	168,376,431.30
其中：股票投资	118,018.04	0.00
债券投资	61,690,194.83	168,376,431.30
买入返售金融资产	0.00	4,800,000.00
应收证券清算款	1,430,962.80	126,418.87
应收利息	1,138,271.49	2,681,495.00
<b>资产合计</b>	<b>153,759,713.83</b>	<b>189,028,170.10</b>
<b>负债和所有者权益：</b>		
<b>负债：</b>		
卖出回购金融资产款	0.00	38,000,000.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	103,585,046.47	0.00
应付管理人报酬	98,722.41	88,993.85
应付托管费	28,206.40	25,426.80
应付销售服务费	37,125.54	33,479.63
应付交易费用	9,906.92	2,535.89
应交税费	155,977.54	142,859.09
应付利息	0.00	14,343.56
应付利润	0.00	0.00
其他负债	109,865.80	162,500.00
<b>负债合计</b>	<b>104,024,851.08</b>	<b>38,470,138.82</b>
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	48,000,029.76	147,736,819.74

未分配利润	1,734,832.99	2,821,211.54
所有者权益合计	49,734,862.75	150,558,031.28
负债和所有者权益总计	153,759,713.83	189,028,170.10

注：截至2021年9月3日(基金最后运作日)，浙商汇金聚禄一年定期A基金份额净值1.0455元，浙商汇金聚禄一年定期C基金份额净值1.0320元；基金份额总额48,000,029.76份，下属分级基金的份额总额分别为：浙商汇金聚禄一年定期A基金份额总额14,778,605.84份，浙商汇金聚禄一年定期C基金份额总额33,221,423.92份。

### 3.2 利润表(已审计)

会计主体：浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金

报告期间：2021年1月1日至2021年9月3日(基金最后运作日)

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年9月3日 (基金最后运作日)	上年度可比期间 2020年1月1日至 2020年12月31日
<b>一、收入</b>	6,872,564.23	42,261,313.90
利息收入	5,888,321.80	46,333,917.48
其中：存款利息收入	36,984.22	232,194.55
债券利息收入	5,778,181.84	41,382,624.69
资产支持证券利息收入	0.00	339,945.68
买入返售证券收入	73,155.74	4,379,152.56
投资收益	-626,070.02	-1,035,464.34
其中：股票投资收益	27,767.66	0.00
债券投资收益	-653,952.88	-728,635.34
资产支持证券投资收益	0.00	-71,960.55
衍生工具收益	0.00	-234,868.45
股利收益	115.20	0.00
公允价值变动收益	1,610,197.70	-3,038,752.79
其他收入	114.75	1,613.55
增值税抵减	0.00	0.00
<b>减：二、费用</b>	2,161,926.69	17,369,551.65

管理人报酬	716,075.80	6,068,625.66
托管费	204,593.13	1,733,893.02
销售服务费	269,268.79	2,111,085.36
交易费用	10,484.69	16,884.22
利息支出	804,952.47	7,101,204.47
其中：卖出回购金融资产支出	804,952.47	7,101,204.47
增值税附加	19,130.15	138,158.92
其他费用	137,421.66	199,700.00
<b>三、利润总和</b>	<b>4,710,637.54</b>	<b>24,891,762.25</b>
减：所得税费用	0.00	0.00

注：财务报告已经北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师陈树华、朱佳明出具了[2021]京会兴专字第68000079号标准无保留意见的审计报告。

## § 4 清算情况

自2021年9月4日至2021年9月24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** 本基金最后运作日存出保证金金额6,464.07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。该款项预计将于2021年10月11日调整为0元。

**4.1.2** 本基金最后运作日结算备付金金额1,277,071.85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。该款项预计将于2021年10月11日调整为6,928.42元。

**4.1.3** 本基金最后运作日期货保证金金额764,285.27元，为存放于浙商期货有限公司的期货保证金。该款项于2021年9月14日划入托管账户。

**4.1.4** 本基金最后运作日交易性金融资产61,808,212.87元，为了保护基金份额持有人利益，截至2021年9月14日，上述交易性金融资产已全部卖出，扣除交易费用后的变现金额（含应收利息）为人民币63,109,802.88元。

4.1.5 本基金最后运作日应收利息为1,138,271.49元。其中应收债券利息1,122,783.56元，截至2021年9月14日该款项已于债券卖出时变现所得。应收活期银行存款利息为8,674.07元，应收结算备付金利息为6,795.41元，应收存出保证金利息金额为18.45元，上述款项已于2021年9月22日结息并于当日划入托管账户。

4.1.6 本基金最后运作日应收证券清算款1,430,962.80元。该款项于2021年9月6日划入托管账户。

## 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98,722.41元，该款项于2021年9月15日支付。

4.2.2 本基金最后运作日应付托管费28,206.40元，该款项于2021年9月15日支付。

4.2.3 本基金最后运作日应付销售服务费37,125.54元，该款项于2021年9月15日支付。

4.2.4 本基金最后运作日应付赎回款103,585,046.47元，该款项于2021年9月7日付清。

4.2.5 本基金最后运作日应付赎回费344.14元，该款项于2021年9月7日付清。

4.2.6 本基金最后运作日应交税费155,977.54元，该款项于2021年9月15日付清。

4.2.7 本基金最后运作日应付交易费用9,906.92元，该款项于2021年9月22日付清。

4.2.8 本基金最后运作日预提费用109,521.66元，其中预提的年度审计费28,644.24元于2021年9月13日调整为清盘审计费4,000.00元，并于2021年9月17日付清，预提的信息披露费80,877.42元于2021年9月22日调整为100,000.00元；本基金于2021年9月15日预提律师费为20,000.00元，于2021年9月17日支付。本基金于2021年9月23日预提银行手续费50,242.37元。

#### 4.3 清算期间（2021年9月4日截止至2021年9月24日）清算损益情况

4.3.1 截止至2021年9月24日的利息收入金额216,617.74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、债券利息收入以及计提的自2021年9月25日至2021年10月25日的存款利息收入、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307,255.86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1,262.64元。

4.3.3 清算期间产生的其他费用74,020.71元，其中包括银行手续费计提50,242.37元，清算律师费20,000.00元，中债和上清所账户销户时缴纳的账户维护费9,300.00元，信息披露费计提19,122.58元，审计费调减24,644.24元。

4.3.4 清算期间产生的公允价值变动损益金额-299,490.07元，系本基金股票、债券投资估值增值额。

4.3.5 清算期间产生的税金及附加金额566.01元。

4.3.6 按照《基金合同》的约定，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，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。

#### 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2021年9月3日基金净资产	49,734,862.75
二、2021年9月4日截止至2021年9月24日基金份额交易产生的基金净值变动数	0.00
加：申购款	0.00
减：赎回款	0.00
加：清算期间净收益	148,534.17
三、2021年9月24日基金净资产	49,883,396.92

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2021年9月24日止的剩余净资产为49,883,396.92元，下属分级基金的净资产分别为：浙商汇金聚禄一年定期A净资产15,497,596.33元，浙商汇金聚禄一年定期C净资产34,385,800.59元。

截至2021年9月24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人民币48,714,461.01元，存出保证金6,464.07元，清算备付金1,277,071.85元，应收利息35,642.36元。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 《浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金清算审计报告》
- 5.1.2 《上海市通力律师事务所关于〈浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金清算报告〉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。

浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

清算报告出具日：2021年9月30日