

财通资管智选核心回报 6 个月持有期混合型发起式证券投资  
基金  
清算报告

基金管理人:财通证券资产管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告出具日期: 2024 年 06 月 11 日

报告送出日期: 2024 年 06 月 20 日

## § 1 重要提示

财通资管智选核心回报6个月持有期混合型发起式证券投资基金(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[2021]977号注册,于2021年5月7日正式生效,本基金的基金管理人为财通证券资产管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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《财通资管智选核心回报6个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)的规定,本基金于基金合同生效满三年之日(2024年5月7日)日终基金资产净值低于2亿元,出现基金合同终止事由。财通证券资产管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)自2024年5月8日起根据相关法律法规、基金合同等规定履行基金财产清算程序。

本基金自2024年5月8日起进入清算期,由基金管理人财通证券资产管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(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,并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金清算报告进行审计,上海市通力律师事务所对本基金清算报告出具法律意见。

## § 2 基金概况

基金名称	财通资管智选核心回报6个月持有期混合型发起式证券投资基金	
基金简称	财通资管智选核心回报6个月持有期混合	
基金主代码	011987	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年05月07日	
基金管理人	财通证券资产管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
基金最后运作日 (2024年05月07日) 基金份额总额	12,442,668.08份	
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过对不同资产类别的优化配置,充分挖掘市场潜在的投资机会,力求实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	1、资产配置策略;2、股票投资策略;3、债券投资策略;4、资产支持证券投资策略;5、金融衍生产品投资策略。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+中债综合指数收益率×45%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。	
下属分级基金的基金简称	财通资管智选核心回报6个月持有期混合A	财通资管智选核心回报6个月持有期混合C
下属分级基金的交易代码	011987	011988
报告期末下属分级基金的份额总额	12,261,453.74份	181,214.34份

## § 3 基金运作情况说明

财通资管智选核心回报 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金(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[2021]977 号《关于准予财通资管智选核心回报 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金注册的批复》注册,由财通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》和《财通资管智选核心回报 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。根据《财通资管智选核心回报 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金对每份基金份额设置 6 个月的最短持有期。最短持有期起始日指基金合同生效日(对认购份额而言)、基金份额申购确认日(对申购份额而言)或基金份额转换转入确认日(对转换转入份额而言);最短持有期到期日指该基金份额最短持有期起始日起次 6 个月的月度对日。如无此月度对日或该对日为非工作日,则顺延至下一工作日。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 10,032,316.92 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0455 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《财通资管智选核心回报 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2021 年 5 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 10,035,017.32 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,700.40 份基金份额。本基金的基金管理人为财通证券资产管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

自 2021 年 5 月 7 日至 2024 年 5 月 7 日期间,本基金按基金合同正常运作。

本基金自 2024 年 5 月 8 日起进入清算期,由基金管理人财通证券资产管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于 2024 年 5 月 8 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。

#### § 4 财务会计报告

资产负债表(已经审计)

会计主体:财通资管智选核心回报 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金

报告截止日:2024 年 5 月 7 日(基金最后运作日)

单位:人民币元

资产	本期末 2024 年 5 月 7 日(基金最后运作日)
<b>资产:</b>	
银行存款	601,007.68
结算备付金	309,671.10
存出保证金	5,616.18
交易性金融资产	7,053,357.75
其中:股票投资	4,593,561.00
债券投资	2,459,796.75
应收清算款	379,109.84
<b>资产总计</b>	<b>8,348,762.55</b>
<b>负债:</b>	
应付赎回款	87,546.38
应付管理人报酬	1,891.11

应付托管费	236.39
应付销售服务费	13.39
应付交易费用	6,239.52
应交税费	89.71
<b>负债合计</b>	<b>96,016.50</b>
<b>净资产：</b>	
实收基金	12,442,668.08
未分配利润	-4,189,922.03
<b>净资产合计</b>	<b>8,252,746.05</b>
<b>负债和净资产总计</b>	<b>8,348,762.55</b>

注：1. 报告截止日 2024 年 5 月 7 日(基金最后运作日)，基金份额总额 12,442,668.08 份，其中财通资管智选核心回报 6 个月持有期混合 A 基金份额净值 0.6634 元，份额总额 12,261,453.74 份；财通资管智选核心回报 6 个月持有期混合 C 基金份额净值 0.6517 元，份额总额 181,214.34 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 5 月 7 日(基金最后运作日)止期间。

## § 5 清算情况

自 2024 年 5 月 8 日至 2024 年 6 月 11 日止为本基金清算期间，基金财产清算小组按照法律法规及《基金合同》的规定履行基金财产清算程序，全部工作按清算原则和清算手续进行。截止清算期结束日（2024 年 6 月 11 日），各项资产负债清算情况如下：

### 一、 资产处置情况：

1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 601,007.68 元，其中活期存款本金为人民币 600,654.97 元，应计利息为人民币 352.71 元；截至清算期结束日银行存款余额为人民币 8,115,037.24 元，其中活期存款本金为人民币 8,111,325.89 元，应计利息为人民币 3,711.35 元。

2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 309,671.10 元，其中上交所最低备付金本金为人民币 17,639.40 元，应计利息为人民币 49.12 元；深交所最低备付金本金为人民币 37,162.08 元，应计利息为人民币 73.56 元；期货备付金本金为人民币 254,188.04 元，应计利息为人民币 558.90 元；截至清算期结束日结算备付金余额为人民币 232.71 元，其中应计上海结算备付金利息为人民币 117.16 元，应计深圳结算备付金利息为人民币 115.55 元。

3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 5,616.18 元,其中上交所结算保证金本金为人民币 2,172.89 元,应计利息为人民币 4.56 元,深交所结算保证金本金为人民币 3,432.36 元,应计利息为人民币 6.37 元;截至清算期结束日存出保证金余额为人民币 17.68 元,其中应计上海存出保证金利息为人民币 7.26 元,应计深圳存出保证金利息为人民币 10.42 元。

4) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 7,053,357.75 元,已最晚于 2024 年 5 月 9 日全部变现,相关证券清算款已最晚于 2024 年 5 月 10 日划入托管账户。

5) 本基金最后运作日应收清算款为人民币 379,109.84 元,该款项已于清算期间划入托管账户。

## 二、 负债清偿情况

1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 87,546.38 元,该款项于 2024 年 5 月 8 日支付,于清算结束日应付赎回款余额为人民币 0.00 元。

2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,891.11 元,清算期间未有变动。

3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 236.39 元,清算期间未有变动。

4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 13.39 元,清算期间未有变动。

5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 6,239.52 元,清算期间计提应付交易费用人民币 2,042.73 元,于清算结束日应付交易费用余额为人民币 8,282.25 元。

6) 本基金最后运作日应交税费为人民币 89.71 元,清算期间计提应交税费人民币 0.75 元,清算期间支付应交税费人民币 81.76 元,于清算结束日应交税费余额为人民币 8.70 元。

## 三、 清算期清算损益情况

报告期间: 2024 年 5 月 8 日(清算期起始日)-2024 年 6 月 11 日(清算终止日)

单位: 人民币元

项目	金额
<b>一、清算期间收入</b>	<b>-10,800.34</b>
存款利息收入	3,557.00
投资收益	63,653.70
公允价值变动损益	-78,011.04
<b>二、清算期间费用</b>	<b>247.28</b>
税金及附加	0.08
汇划费	247.20
<b>三、清算期间净损益</b>	<b>-11,047.62</b>

## 四、清算结束后所有者权益情况说明

项目	金额
一、最后运作日（2024年5月7日）基金净资产	8,252,746.05
加：清算报告期间净收益	-11,047.62
减：赎回金额（含费用）	137,029.84
二、清算结束日（2024年6月11日）基金净资产	8,104,668.59

资产处置及负债清偿后，截止本基金清算报告期结束日2024年6月11日，本基金剩余财产为8,104,668.59元。根据《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（其中，清算费用中的律师费用、审计费用由基金管理人承担）、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。清算分配结束后，基金管理人垫付资金需在相关机构实际退款后方能收回，由基金托管人扣除银行手续费等费用后偿付垫付的资金，与实际结算金额的尾差由基金管理人承担。

## 五、基金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析。

## §6 备查文件

## 备查文件目录

1、财通资管智选核心回报6个月持有期混合型发起式证券投资基金2024年1月1日至2024年5月7日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告；

2、关于《财通资管智选核心回报6个月持有期混合型发起式证券投资基金清算报告》的法律意见。

## 存放地点

上海市浦东新区栖霞路26弄富汇大厦B座8、9层

浙江省杭州市上城区新业路300号中国人寿大厦2幢22层

## 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人财通证券资产管理有限公司。

咨询电话：400-116-7888

公司网址：www.ctzg.com

财通资管智选核心回报6个月持有期混合型发起式证券投资基金  
基金财产清算小组

二〇二四年六月十一日