

# 汇添富睿丰混合型证券投资基金(LOF)清算报告

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二四年一月十八日

报告公告日期：二〇二四年二月八日

# 目 录

一、重要提示 .....	1
二、基金概况 .....	2
三、基金运作情况概述 .....	4
四、财务会计报告 .....	5
五、清算情况 .....	6
六、备查文件 .....	9

## 一、重要提示

汇添富睿丰混合型证券投资基金(LOF) (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】223 号文注册募集。本基金的基金托管人为中国银行股份有限公司。

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》、《汇添富睿丰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, 本基金出现了基金合同终止事由。汇添富基金管理股份有限公司 (以下简称“本公司”或“基金管理人”) 将根据相关法律法规、《基金合同》的约定对本基金进行清算, 并终止《基金合同》, 无需召开基金份额持有人大会审议。

根据基金管理人于 2024 年 1 月 3 日发布的《关于汇添富睿丰混合型证券投资基金(LOF) 进入清算期及终止基金合同的公告》, 本基金自 2024 年 1 月 17 日起进入清算程序, 由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、安永华明会计师事务所 (特殊普通合伙) 和上海市通力律师事务所于 2024 年 1 月 17 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序, 并由安永华明会计师事务所 (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。

## 二、基金概况

基金名称	汇添富睿丰混合型证券投资基金(LOF)	
基金简称	汇添富睿丰混合(LOF)	
基金简称	汇添富睿丰混合(LOF)A	汇添富睿丰混合(LOF)C
基金代码	501039	501040
场内简称	添富睿丰	添富睿 C
扩位证券简称	添富睿丰 LOF	添富睿丰 LOFC
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 9 月 29 日	
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人名称	中国银行股份有限公司	
最后运作日(2024 年 1 月 16 日)基金份额总额	3,852,344.96 份	
投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类资产，并通过投资股票等权益类资产增强收益，在科学严格管理风险的前提下，力争创造超越业绩比较基准的长期稳健收益。	
主要投资策略	<p>本基金将密切关注市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，判断不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，以动态调整大类资产配置比例。在此基础上，灵活运用债券投资策略、股票精选策略等。</p> <p>封闭期内，本基金采取的投资策略主要为资产配置策略、债券投资策略、定向增发策略、定增破发策略、股票精选策略等；转为上市开放式基金后，本基金采取的投资策略主要为资产配置策略、债券投资策略、股票精选策略等。本基金的投资策略还包</p>	

	括：资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、融资投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金，属于中等收益风险特征的基金。

### 三、基金运作情况概述

本基金经中国证监会《关于准予汇添富睿丰混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2017】223号文）准予注册募集，本基金由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司于2017年8月14日至2017年9月26日向社会公开发行募集，汇添富睿丰混合型证券投资基金的基金合同于2017年9月29日生效，基金合同生效日的基金份额总数为332,816,128.72份（含募集期间利息结转的份额）。

根据《基金合同》及《汇添富睿丰混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定，汇添富睿丰混合型证券投资基金封闭期自2017年9月29日至2019年3月28日止。

自2019年3月29日起，汇添富睿丰混合型证券投资基金转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“汇添富睿丰混合型证券投资基金（LOF）”。

自2017年9月29日至2024年1月16日期间，本基金按基金合同正常运作。

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》、《基金合同》的有关规定，本基金出现了基金合同终止事由。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“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：

“《基金合同》生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，本基金将按照基金合同的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会。

法律法规另有规定时，从其规定。”

截至2024年1月2日日终，本基金的基金资产净值连续60个工作日低于5000万元，本基金已触发基金合同终止的上述情形。本公司将根据相关法律法规、《基金合同》的约定对本基金进行清算，并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会审议。根据基金管理人于2024年1月3日发布的《关于汇添富睿丰混合型证券投资基金(LOF)进入清算期及终止基金合同的公告》，本基金自2024年1月17日起进入清算程序。

## 四、财务会计报告

### 1. 基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：汇添富睿丰混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2024年1月16日（本基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2024年1月16日
资产：	
银行存款	4,443,599.09
结算备付金	27,086.77
存出保证金	13,206.59
资产总计：	4,483,892.45
负债和净资产	最后运作日 2024年1月16日
应付赎回款	40,727.32
应付管理人报酬	3,209.52
应付托管费	534.92
应付销售服务费	367.63
其他负债	20,000.00
负债合计	64,839.39
净资产：	
实收基金	3,852,344.96
未分配利润	566,708.10
净资产合计	4,419,053.06
负债和净资产总计	4,483,892.45

注：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》等有关规定编制的。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，本清算报表并无可比期间的相关数据列示。

## 五、清算情况

本基金的清算期间为自 2024 年 01 月 17 日至 2024 年 01 月 18 日。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

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。按照《基金合同》的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 4,443,599.09 元，其中托管户存款为人民币 4,442,064.08 元，应计银行存款利息为人民币 1,535.01 元，应计银行存款利息将由基金管理人以自有资金先行垫付。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 27,086.77 元，其中存放于中国证券登记结算有限公司的结算备付金为人民币 26,951.88 元，应计结算备付金利息为人民币 134.89 元，上述款项将由基金管理人以自有资金先行垫付。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 13,206.59 元，其中存放于中国证券登记结算有限公司的存出保证金为人民币 13,191.83 元，应计存出保证金利息为人民币 14.76 元，上述款项将由基金管理人以自有资金先行垫付。

### 3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 40,727.32 元，该款项已于 2024 年 1 月 17 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 3,209.52 元，该款项已于 2024 年 1 月 18 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 534.92 元，该款项已于 2024 年 1



月 18 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 367.63 元，该款项已于 2024 年 1 月 18 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付其他负债为人民币 20,000.00，系本基金清盘产生的清算审计费人民币 5,000.00 元和清算律师费人民币 15,000 元，该款项已于 2024 年 1 月 18 日支付。

#### 4、清算损益情况说明

单位：人民币元

项目	自 2024 年 1 月 17 日至 2024 年 1 月 18 日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注 1）	86.64
2、其他收入（注 2）	483.54
清算收益小计	570.18
二、清算支出	
1、其他费用（注 3）	55.00
清算支出小计	55.00
三、清算净收益	515.18

注 1：利息收入系自 2024 年 1 月 17 日起至 2024 年 1 月 18 日止清算期间的银行存款、结算备付金、存出保证金利息收入。

注 2：其他收入系自 2024 年 1 月 17 日起至 2024 年 1 月 18 日止清算期间的赎回费收入。

注 3：其他费用系自 2024 年 1 月 17 日起至 2024 年 1 月 18 日止清算期间的银行存款汇划手续费。

#### 5、剩余资产分配情况说明

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2024 年 1 月 16 日基金净资产	4,419,053.06

加：清算期间净收益	515.18
减：基金净赎回金额（于 2024 年 1 月 17 日确认的投资者赎回申请）	-237,571.87
二、清算结束日 2024 年 1 月 18 日基金净资产	4,181,996.37

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日 2024 年 1 月 18 日，本基金剩余财产为人民币 4,181,996.37 元。根据本基金的基金合同，本基金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，按基金份额持有人的基金份额比例进行分配。

自本次清算期起始日 2024 年 1 月 17 日至清算款划出前一日产生的银行存款、结算备付金、存出保证金利息归基金份额持有人所有，后续产生的各类划付手续费由投资者承担。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，该部分利息将由基金管理人以自有资金垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

## 6、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，报上海证监局备案并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分配。

## 六、备查文件

### 1、备查文件目录

- (1) 汇添富睿丰混合型证券投资基金(LOF)清算审计报告
- (2) 《上海市通力律师事务所关于〈汇添富睿丰混合型证券投资基金(LOF)清算报告〉的法律意见》

### 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。

汇添富睿丰混合型证券投资基金(LOF)

基金财产清算小组

二〇二四年一月十八日